

广发聚丰股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

[2007年第1号]

基金管理人:广发基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

【重要提示】
广发聚丰股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2006年11月1日经中国证监会证监基金字[2006]180号文核准募集。本基金基金合同于2006年12月23日生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。
投资有风险,投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。本招募说明书基金合同和本基金招募说明书,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务的法律文件,基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受,并依《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金合同。
本基金的基金合同已经载明了《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关基金的法律、法规和规范性文件,并载明基金的投资目标和投资策略。
本招募说明书所载内容截止日为2006年12月22日,有关财务数据和净值截止日为2006年9月30日(财务数据未经审计)。

【基金管理人概况】
(一)基金管理人概况
名称:广发基金管理有限公司
注册地址:广东省珠海市横琴新区北环路19号广发商业大厦1208室
办公地址:广州市天河区体育西路17号红石大厦14.15楼
成立时间:2003年8月5日
法定代表人:孙树培
注册资本:12亿元人民币
电话:020-85628601
联系人:陈霄
【基金管理人主要人员】
董事长:朱江,广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)、广州科技风险投资有限公司、香港投资管理有限公司和烽火通信科技股份有限公司共同发起设立,分别持有本基金管理人48.33%、18.33%、16.67%和16.67%股份。
1.董事成员
马庆泉,董事长,男,博士,教授,研究员,中国人民大学博士生导师,第三届中国证券业协会副会长,中国证券业协会基金委员会副主任委员,深圳证券交易所研究中心主任,副教授,广发证券股份有限公司董事、副总裁、嘉实基金管理有限公司董事长,第二届中国证券业协会秘书长等职务。
刘煜辉,董事,男,硕士,高级经济师,曾任广发证券财务总监,投资银行部常务副总经理,投资自营部总经理,投资银行部副经理,现任广发证券副总裁。
符学亮,董事,男,大学本科学历,曾任广州市星城公司副总经理兼任星城生物工程(香港)有限公司副总经理,广州科技开发总公司总经理助理,广州科技实业发展有限公司常务副总经理,广州科技风险投资有限公司总经理,现任广州科技风险投资有限公司董事长,兼任广州生产力促进中心副主任,广州科达实业发展有限公司总经理,广州科技风险投资有限公司常务副总经理。
李耀阳,董事,男,EMBA,高级经济师,曾任武汉邮电科学研究院党委书记,市场规划部副主任,长沙爱立信电信设备有限公司财务总监、副总会计师,烽火通信科技股份有限公司财务管理部总经理,现任烽火通信科技股份有限公司财务总监。
董云薇,独立董事,男,法学博士,教授,曾任复旦大学法律系副主任,现任复旦大学法学院教授。
姚海鑫,独立董事,男,经济学博士,教授,博士生导师,曾任中山大学工商管理学院院长兼中山大学工商管理学院(MBA)中心主任,现任中山大学管理学院教授。
罗彦平,独立董事,男,经济学博士,曾任中国工商银行总行副经理,中国人民保险(集团)公司湖北分公司业务处长、中国人民保险公司湖北省国际部总经理,中国人民保险(集团)汉口分公司总经理,现任太平洋保险湖北分公司总经理。
2.监事会成员
余和平,监事长,女,经济学博士,曾任广发证券成都营业部总经理,广发证券投资部副总经理,嘉实基金管理有限公司副总经理,董事。
王益金,监事,男,硕士研究生学历,曾任兰州大学教师,广州第一律师事务所律师,广州宝达有限公司法律部经理,美国友邦保险(中国)分公司和友邦保险(中国)分公司助理总经理和法律顾问,现任香港汇集团董事会秘书、总裁助理。
双文江,监事,女,经济学硕士,曾任广发证券研发中心研究员,现任广发基金管理有限公司市场部副经理。
3.总经理及其他高级管理人员
林广德,总经理,男,大学本科学历,曾任广发证券投行总部企业业务部总经理,投资银行部副总经理兼融资部执行总经理,现任广发证券投行部副总经理,投资银行部常务副总经理。
肖剑,副总经理,女,企业管理硕士,高级经济师,曾任珠海国际信托投资公司助理总经理,广发证券电子商务部副总经理,广发证券投资部副总经理。
李海,副总经理,男,工商管理硕士,曾任上海聚信国际集团市场部经理,广发证券公司投资银行部华南业务部副总经理,基金科基金经理,易方达基金管理有限公司市场部研究负责人,广发基金管理有限公司总经理助理。
4.基金经理
魏庆方,男,经济学硕士,总经理助理兼资产管理部总经理,广发聚富基金经理,广发聚丰基金经理,9年证券从业经历,曾从事股权投资、资产管理业务,曾任广发证券投资银行部业务员,广发证券投资自营部副经理。
5.本基金投资决策集体决策制度,投资决策委员会成员的姓名及职务如下:
主席:公司总经理林广德;成员:公司副总经理朱平,资产管理部总经理魏庆方,研究发展部总经理许雪梅。
二、基金托管人
(一)基金托管人概况
名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街66号
成立时间:1985年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币286,500,130,126元
联系电话:010-66106912
(二)主要人员情况
中国工商银行资产托管部共有员工77人,平均年龄30岁,90%以上员工具有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学历或高级职称。
(三)基金托管业务资格
作为由中国银监会批准开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行始终恪守“诚实信用、勤勉尽责”的原则,严格履行资产托管人的责任和义务,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系,规范的业务管理模式,健全的市场准入机制,强大的市场服务能力,为广大基金持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至2006年9月,托管证券投资基金67只,其中封闭式16只,开放式51只,托管资产规模年均递增73%。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资金、社保基金、企业年金、产业基金、QFII资产、期货产品等共四大类14项证券投资基金业务。继2004年先后获得《亚洲货币》杂志“全球托管人”评选的“中国最佳托管银行”称号后,2006年,又分别获得《财富》和《全球财经》评选的“中国最佳托管银行”称号。
三、相关服务机构
(一)基金销售服务机构
1.直销机构
本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司为投资人办理开放式基金开户、认购、申购、赎回、基金转换业务。
(1)广州分公司
地址:广州市体育西路57号广东红石大厦14层
客户服务电话:0610682828(020-83380999)
传真:020-85628601
联系人:李慧敏
(2)北京分公司
地址:北京市西城区月坛北街2号月坛大厦17楼
电话:010-68083077
传真:010-68083078
(3)上海分公司
地址:上海市浦东新区陆家嘴东路中保大厦2908室
电话:021-68885310
传真:021-68885200
基金管理人网址: www.gfund.com.cn
2.代销机构
(1)名称:中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街66号
法定代表人:姜建清
联系人:田甜
电话:010-66107000
传真:010-66109714
客户服务电话:96588
公司网址: www.icbc.com.cn
(2)名称:招商银行股份有限公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
联系人:刘刚
电话:0755-82090060
传真:0755-82090817
客户服务电话:95555
公司网址: www.cmbchina.com
(3)名称:广发证券股份有限公司
住所:广州市天河区体育西路17号红石大厦53号
法定代表人:孙树培
联系人:江鹏
电话:020-38227204
传真:020-47711111
公司网址: http://efank.gd.com.cn
(4)名称:兴业银行股份有限公司
注册地址:福州市城庆路154号
办公地址:福州市五一中路元洪大厦25层
法定代表人:高建平
联系人:陈福祥
电话:(0591)88012622
传真:(0591)83318855
客户服务电话:96361
网址: www.cib.com.cn
(5)名称:深圳发展银行股份有限公司
办公地址:深圳市福田区深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:马建超
联系人:李慧敏
电话:0755-82088888
传真:0755-82088774
客户服务电话:95501
公司网址: www.sdb.com.cn
(6)名称:上海银行
住所:上海市四川路288号18层
法定代表人:李卫
联系人:夏雯
电话:021-63217088
传真:021-63217203
客户服务电话:021-962988
公司网址: www.shbank.com.cn
(7)名称:广发证券股份有限公司
注册地址:广东省珠海市吉大海傍路光大贸易中心
办公地址:广州市天河区天河北路133号大都会广场36、38、41、42楼
法定代表人:孙树培
联系人:肖中明
电话:020-37655888-875
传真:020-37657088
客户服务电话:020-87658888 转各营业网点

公司网址: www.gfund.com
(8)名称:中国工商银行股份有限公司
住所:福州市鼓楼区温德姆西道157号7-8层
法定代表人:王世
联系人:吴洪波
电话:0591-87383021
电话:0591-87383013
客户服务电话:0591-87383333 或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址: www.cib.com.cn
(9)名称:兴业银行股份有限公司
住所:福州市湖东路99号海峡大厦
法定代表人:高建平
联系人:陈福祥
电话:021-68419974
电话:021-68415987
客户服务电话:021-68419125
公司网址: www.xycq.com.cn
(10)名称:申银万国证券股份有限公司
住所:上海市常熟路171号
法定代表人:胡刚
联系人:王序芬
电话:021-68889888
传真:021-54038844
客户服务电话:021-9625206
公司网址: www.sw2000.com.cn
(11)名称:国泰君安证券股份有限公司
住所:南京市中山东路101号
法定代表人:王松华
联系人:李洪波
电话:021-68889888
传真:021-68889888
客户服务电话:021-68889888
公司网址: www.gtja.com.cn
(12)名称:国信证券股份有限公司
住所:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人:何如
联系人:林国达
电话:0755-82130833-2181
传真:0755-82133302
公司网址: www.guosen.com.cn
(13)名称:平安证券有限责任公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层
法定代表人:曹玉升
联系人:黄健
电话:0755-82943217
传真:0755-82943217
客户服务电话:020-8888-1111, 0755-26951111
公司网址: www.pingan.com.cn
(14)名称:方正证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路168号中银大厦30层
法定代表人:李平
联系人:金磊
电话:021-68604866
传真:021-50372474
客户服务电话:021-68904866
公司网址: www.fundoo.com.cn
(15)名称:中原证券股份有限公司
住所:河南省郑州市郑东新区东三环15号中原国际贸易大厦11楼
法定代表人:张华
联系人:张华
电话:0371-65565118
传真:0371-65565118
客户服务电话:0371-56721818 或 65565676
公司网址: www.ccnew.com
(16)名称:山西证券股份有限公司
住所:山西省太原市府西街69号山西国际中心东塔楼
法定代表人:吴喜安

联系人:刘文霞
电话:0351-8638708
传真:0351-8638708
客户服务电话:0351-8638868
公司网址: www.sxsc.com.cn
(2)名称:华泰证券有限责任公司
住所:南京市中山北路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:025-8487777-248
电话:025-84579763
联系人:邵小波
客户服务电话:025-84579897
公司网址: www.htsc.com.cn
(3)名称:湘财证券有限责任公司
住所:长沙市黄兴中路63号中融国际大厦12楼
法定代表人:陈学军
联系人:陈伟
电话:021-68634818-8631
电话:021-68639838
客户服务电话:021-68865020
公司网址: www.xcsc.com 和 www.xcstart.com
(4)名称:国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区华银北路裕泰广场45层
办公地址:深圳市福田区安海路光大大厦3层
法定代表人:王少华
电话:010-64482828-330
传真:010-64482828
客户服务电话:030-8101-8909
公司网址: www.guodu.com
(5)名称:国海证券股份有限公司
住所:南宁市滨湖路46号
法定代表人:张锦辉
联系人:覃芳清
电话:0771-5832022
传真:0771-5839033
客户服务电话:4008881000(全国), 96100(广西)
公司网址: www.guohai.com.cn
(6)名称:国联证券股份有限公司
住所:无锡市太湖新城188号
办公地址:无锡市太湖新城188号
法定代表人:袁茂
联系人:袁勇
电话:0510-82831622
传真:0510-82830162
客户服务电话:0510-82881688
公司网址: www.guosen.com.cn
(7)名称:九州证券股份有限公司
住所:广州市天河区广九路9号东广广场五楼
法定代表人:吴志勇
联系人:江波
电话:020-87222668
传真:020-87226036
客户服务电话:08132011
公司网址: www.jiuzhou.com.cn
(8)名称:第一创业证券股份有限公司
住所:深圳市福田区福华一路118号
法定代表人:刘学军
联系人:杨锦
电话:0757-25832896
传真:0757-26317118
公司网址: www.fysec.cn
(二)注册登记机构
名称:广发基金管理有限公司
注册地址:广东省珠海市横琴新区北环路19号广发商业大厦1208室
办公地址:广州市天河区体育西路57号红石大厦14.15楼
法定代表人:孙树培
电话:020-85628601
联系人:李海
(三)律师事务所和经办律师
名称:广东信达律师事务所
住所:深圳市福田区深南大道21楼
负责人:许晓峰
电话:0755-83241339
传真:0755-82143108
联系人:李少娟
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:深圳鹏城会计师事务所有限公司
住所:深圳市福田区福华一路118号
法定代表人:饶涛
电话:0755-82203222
传真:0755-82203749
经办注册会计师:杨景瑞、侯立勋
联系人:杨景瑞
电话:021-68601136
传真:021-68608021
公司网址: www.dwgq.com.cn
(19)名称:光大证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路528号上海证券大厦南塔15-16楼
法定代表人:王明凯
联系人:刘诚
电话:021-68816000
传真:021-68816009
客户服务电话:021-68823886
公司网址: www.ebscn.com
(20)名称:国信证券股份有限公司
住所:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人:何如
联系人:林国达
电话:0755-82130833-2181
传真:0755-82133302
公司网址: www.guosen.com.cn
(21)名称:海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
联系人:金芸
电话:021-53594569
传真:021-53594649
客户服务电话:021-962503
公司网址: www.htsec.com
(22)名称:中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区安业路66号4号楼
法定代表人:郭树清
联系人:王莉
电话:010-66181888
传真:010-66181898
公司网址: www.ccb.com.cn
(23)名称:联合证券有限责任公司
住所:深圳前海深港合作区5047号深圳发展银行大厦10.24.25层
联系人:范智勇
电话:0755-82492000
传真:0755-82492082
客户服务电话:020-8888-5555
公司网址: www.lhjz.com.cn
(24)名称:平安证券有限责任公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层
法定代表人:曹玉升
联系人:黄健
电话:0755-82943217
传真:0755-82943217
客户服务电话:020-8888-1111, 0755-26951111
公司网址: www.pingan.com.cn
(25)名称:招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层
法定代表人:宫洪涛
联系人:李慧敏
电话:0755-82943217
传真:0755-82943217
客户服务电话:020-8888-1111, 0755-26951111
公司网址: www.newone.com.cn
(26)名称:中国银河证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路168号中银大厦30层
法定代表人:李平
联系人:金磊
电话:021-68604866
传真:021-50372474
客户服务电话:021-68904866
公司网址: www.chinastock.com.cn
(27)名称:中原证券股份有限公司
住所:河南省郑州市郑东新区东三环15号中原国际贸易大厦11楼
法定代表人:张华
联系人:张华
电话:0371-65565118
传真:0371-65565118
客户服务电话:0371-56721818 或 65565676
公司网址: www.ccnew.com
(28)名称:山西证券股份有限公司
住所:山西省太原市府西街69号山西国际中心东塔楼
法定代表人:吴喜安

(2)本基金持有的全部权证,其市值不超过基金资产净值的百分之二。
(3)本基金管理人管理的公募基金持有的同一权证,不超过该权证的百分之十。
九、业绩比较基准
90%×新华富时A600指数收益率+20%×新华富时中国全债指数收益率
十、风险控制措施
较高风险,较高收益。
十一、基金投资组合报告
“广发基金管理有限公司董事会及董监高保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同约定,于2006年10月19日复核了本
报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告所载数据截至2006年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。”

1. 期末基金资产净值组合

股票	市值(元)	占总资产的比重
债券	2,656,226,403.98	92.58%
权证	0	0
现金	7,151,030.00	0.25%
银行存款和清算备付金	170,292,203.64	5.94%
其他资产	35,432,831.17	1.24%
合计	2,888,101,474.79	100.00%

2. 期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值(元)	净值比占净值比
A农林牧渔业	213,969,302.63	0.77%
B采矿业	213,678,080.22	7.53%
C制造业	1,306,046,867.15	46.02%
C0食品、饮料	366,364,547.59	12.91%
C1纺织服装、皮毛	0.00	0.00%
C2木材、家具	0.00	0.00%
C3医药、生物制品	341,686,964.62	12.14%
C4石油、化学、塑胶、塑料	236,369,829.79	8.33%
C5电子	31,266,634.06	1.10%
C6金属、非金属	248,794,319.41	8.76%
C7机械、设备、仪器	49,894,265.23	1.74%
C8其他制造业	28,308,303.60	1.02%
D电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E建筑业	0.00	0.00%
F交通运输、仓储业	2,008,314.00	0.07%
G信息技术业	208,060,947.09	7.31%
H批发和零售业	466,840,755.22	16.45%
I金融、保险业	66,675,438.36	2.31%
J房地产业	330,428,169.99	11.64%
K其他行业	13,063,578.64	0.46%
L传播与文化产业	0.00	0.00%
M综合类	27,473,956.69	0.97%
合计	2,656,226,403.98	93.54%

3. 期末基金投资组合前十名股票明细

股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	市值占净值比
600084	五粮液	5,127,709	214,338,236.20	7.9510%
002024	苏宁电器	7,721,658	200,531,458.26	7.0646%
600456	广生药业	5,974,326	168,976,814.86	5.6007%
600316	鲁商置业	3,742,351	130,346,085.33	4.9292%
600019	华仪股份	2,726,490	129,743,230.70	4.9708%
000792	盐湖钾肥	6,000,000	110,400,000.00	3.9833%
600028	中国石化	15,944,000	108,265,760.00	3.9139%
600843	海德股份	4,668,669	106,418,320.22	3.7138%
600512	平安电气	6,984,964	102,389,572.24	3.6075%
600087	伊泰煤炭	4,466,100	93,341,490.00	3.2894%

4. 报告期末本基金未有持有债券。
5. 投资组合报告附注
(1) 本基金报告期内投资的市值均不超过基金资产净值的10%。
(2) 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名股票的发行主体未受到公开谴责和处罚。
(3) 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
(4) 本基金本报告期投资前十大重仓股公允价值变动收益为1,667,904.00元,应收益利息42,269.89元,应申购款11,072,424.42元,应收益申购款22,560,232.78元,合计为38,432,831.17元。
(5) 本基金本报告期未有处于转股期的可转换债券。
(6) 本报告期末本基金未有持有被投资发行的权证或权证收益与成本总额列示如下:

权证代码	权证名称	权证数量	成本总额
580005	万华YXB1	610000	16501202

(7) 本基金本报告期未有资产支持证券。
十二、基金业绩
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。本基金业绩数据截至2006年9月30日。
1. 净值增长率与同期业绩比较基准收益比较表

阶段	净值增长率(%)	业绩比较基准增长率(%)	净值增长率-业绩比较基准增长率(%)	(1)-(3)	(2)-(4)
2006.7.1-2006.9.30	3.82	0.0119	1.43%	0.0109	2.39%
2006.1.1-2006.6.30	82.84	0.0142	45.6%	0.0112	37.19%
2006.12.23-2006.12.31	-0.04	0.0020	1.02%	0.0064	-1.06%
自基金合同生效以来至2006年9月30日	93.40	0.0110	40.35%	0.0110	39.23%

2. 本基金自基金合同生效之日起至本报告期末基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图

注:1.业绩比较基准:80%×新华富时A600指数收益率+20%×新华富时中国全债指数收益率
2.本基金本报告期未有持有债券。
3. 投资组合报告附注
(1) 本基金报告期内投资的市值均不超过基金资产净值的10%。
(2) 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名股票的发行主体未受到公开谴责和处罚。
(3) 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
(4) 本基金本报告期投资前十大重仓股公允价值变动收益为1,667,904.00元,应收益利息42,269.89元,应申购款11,072,424.42元,应收益申购款22,560,232.78元,合计为38,432,831.17元。
(5) 本基金本报告期未有处于转股期的可转换债券。
(6) 本报告期末本基金未有持有被投资发行的权证或权证收益与成本总额列示如下:

权证代码	权证名称	权证数量	成本总额
580005	万华YXB1	610000	16501202

(7) 本基金本报告期未有资产支持证券。
十二、基金业绩
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。本基金业绩数据截至2006年9月30日。
1. 净值增长率与同期业绩比较基准收益比较表

阶段	净值增长率(%)	业绩比较基准增长率(%)	净值增长率-业绩比较基准增长率(%)	(1)-(3)	(2)-(4)
2006.7.1-2006.9.30	3.82	0.0119	1.43%	0.0109	2.39%
2006.1.1-2006.6.30	82.84	0.0142	45.6%	0.0112	37.19%
2006.12.23-2006.12.31	-0.04	0.0020	1.02%	0.0064	-1.06%
自基金合同生效以来至2006年9月30日	93.40	0.0110	40.35%	0.0110	39.23%

2. 本基金自基金合同生效之日起至本报告期末基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图

注:1.业绩比较基准:80%×新华富时A600指数收益率+20%×新华富时中国全债指数收益率
2.本基金本报告期未有持有债券。
3. 投资组合报告附注
(1) 本基金报告期内投资的市值均不超过基金资产净值的10%。
(2) 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名股票的发行主体未受到公开谴责和处罚。
(3) 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
(4) 本基金本报告期投资前十大重仓股公允价值变动收益为1,667,904.00元,应收益利息42,269.89元,应申购款11,072,424.42元,应收益申购款22,560,232.78元,合计为38,432,831.17元。
(5) 本基金本报告期未有处于转股期的可转换债券。
(6) 本报告期末本基金未有持有被投资发行的权证或权证收益与成本总额列示如下:

权证代码	权证名称	权证数量	成本总额
580005	万华YXB1	610000	16501202

(7) 本基金本报告期未有资产支持证券。
十二、基金业绩
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。本基金业绩数据截至2006年9月30日。
1. 净值增长率与同期业绩比较基准收益比较表

阶段	净值增长率(%)	业绩比较基准增长率(%)	净值增长率-业绩比较基准增长率(%)	(1)-(3)	(2)-(4)
2006.7.1-2006.9.30	3.82	0.0119	1.43%	0.0109	2.39%
2006.1.1-2006.6.30	82.84	0.0142	45.6%	0.0112	37.19%
2006.12.23-2006.12.31	-0.04	0.0020	1.02%	0.0064	-1.06%
自基金合同生效以来至2006年9月30日	93.40	0.0110	40.35%	0.0110	39.23%

2. 本基金自基金合同生效之日起至本报告期末基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图

注: