

广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF)招募说明书【更新】摘要

(上接 D40 页)

- (5) 根据决策委员会基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由中央交易室执行;
- (6) 中央交易室按有关交易规则执行,并将有关信息反馈基金经理小组;
- (7) 金融工程小组定期进行基金绩效评价,并向投资决策委员会提交综合评价意见和建议;
- (8) 风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,尤其重点关注基金投资组合的风险状况;金融工程小组重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准是:天相小市值指数。

十、风险收益特征

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事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。

基金托管人浦发银行根据本基金基金合同规定,于 2007 年 1 月 17 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 12 月 31 日,本报告中所列财务数据未经审计。

1. 期末基金资产配置组合

	市值(元)	占总资产的比重
股票	1,877,984,802.02	81.57%
债券	0	0.00%
权证	22,640,713.50	0.98%
银行存款和清算备付金	346,657,219.40	15.06%
其他资产	54,997,489.37	2.39%
合计	2,302,280,224.29	100.00%

2. 期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值	净值比
A 农业、牧、渔业	88,794,406.60	3.91%
B 采矿业	99,689,652.64	4.33%
C 制造业	1,189,334,458.96	52.43%
CO 食品、饮料	77,742,581.74	3.43%
C1 纺织服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	36,317,940.00	1.56%
C3 造纸、印刷	41,328,663.30	1.82%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	151,136,585.97	6.66%
CS 电子、电器、通讯、设备	91,239,652.96	4.02%
C8 金属、非金属	224,543,371.38	9.90%
C7 机械、设备、仪表	219,807,867.39	14.10%
C9 医药、生物制品	203,367,358.94	8.96%
C99 其他制造业	44,852,397.38	1.98%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	20,049,020.32	0.88%
E 建筑业	20,970,000.00	0.93%
F 交通运输、仓储业	0.00	0.00%
G 信息技术业	22,810,000.00	1.01%
H 批发和零售贸易	144,846,455.50	6.38%
I 金融、保险业	96,728,932.43	4.28%
J 房地产业	123,282,329.15	5.43%
K 社会服务业	31,876,000.00	1.40%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	39,616,536.40	1.75%
合计	1,877,984,802.02	82.77%

股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	市值占净值比
600022	招商局	13,254,713	101,796,186.94	4.45%
600859	王府井	3,580,000	87,237,000.00	3.84%
600536	天士力	4,656,596	71,789,290.32	3.16%
000933	神火股份	4,891,580	54,834,611.80	2.42%
600438	通威股份	4,001,938	54,186,240.52	2.39%
600786	S 东钢	1,800,000	52,020,000.00	2.29%
000006	深振业 A	3,779,259	50,679,863.19	2.23%
000001	S 深发展 A	3,218,269	46,568,352.43	2.05%
000050	江淮汽车	3,657,986	45,359,026.40	2.00%
601699	紫金矿业	2,789,942	44,856,070.84	1.98%

4. 投资组合报告附注

- (1) 本基金持有的每只股票的价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列入调查,或在本报告期内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) 本基金本报告期其他资产的构成交易保证金 2,580,000.00 元,应收利息 148,226.17 元,应收申购款 52,269,263.20 元,其他应收款 0.00 元,合计为 54,997,489.37 元。
- (5) 本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。
- (6) 本基金本报告期末持有资产支持证券。
- (7) 本基金本报告期末无债券投资。
- (8) 本基金本报告期末持有的权证均为主动投资,投资的权证数量和成本总额列示如下:

权证代码	权证名称	权证数量	成本总额(元)
880007	长电 CWB1	2,240,000	11,051,166.67
030002	五环 YGC1	799,983	9,829,762.30

十二、基金的业绩

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代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2006 年 12 月 31 日。

1. 净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益标准差(%)	(1)-(3)	(2)-(4)
2006.11-2006.12.31	132.29%	0.0148	98.90%	0.0170	33.39%	-0.0022
2006.2.2-2006.12.31	4.82%	0.0112	-8.50%	0.0168	13.32%	-0.0066

2. 本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值变动与同期业绩比较基准比较图

注:业绩比较基准:天相小市值指数

注:业绩比较基准:天相小市值指数

十三、基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用

- 1、与基金运作有关的费用种类
- (1) 基金管理人的管理费;
- (2) 基金托管人的托管费;
- (3) 证券交易费用;
- (4) 基金信息披露费用;
- (5) 基金份额持有人大会费用;
- (6) 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所与律师费;
- (7) 按照国家有关规定和基金合同可以列入的其它费用。

2、与基金运作相关的费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。管理费的计算方法如下:

管理费的计算公式为:

$$H = E \times 1.5\% \div 365$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div 365$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(3) 上述第 1 项中(3)到(7)项费用,由基金托管人根据其有关法规及相应协议的约定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

(4) 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前的相关费用,包括但不限于信息披露费、验资费、会计师事务所和律师费等不列入基金费用。

(5) 基金管理人及基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费,经中国证监会核准后公布,无须召开基金份额持有人大会。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购费

(1)场内申购费

投资人在申购本基金交纳申购费,按申购金额采用比例费率。投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体费率如下:

(上接 D41 页)

1. 适用范围

7.3 重大关联交易

7.4 关联交易

7.5 关联交易

7.6 关联交易

7.7 关联交易

7.8 关联交易

7.9 关联交易

7.10 关联交易

7.11 关联交易

7.12 关联交易

7.13 关联交易

7.14 关联交易

7.15 关联交易

7.16 关联交易

7.17 关联交易

7.18 关联交易

7.19 关联交易

7.20 关联交易

7.21 关联交易

7.22 关联交易

7.23 关联交易

7.24 关联交易

7.25 关联交易

7.26 关联交易

7.27 关联交易

7.28 关联交易

7.29 关联交易

7.30 关联交易

7.31 关联交易

7.32 关联交易

7.33 关联交易

7.34 关联交易

7.35 关联交易

7.36 关联交易

7.37 关联交易

7.38 关联交易

7.39 关联交易

7.40 关联交易

7.41 关联交易

7.42 关联交易

7.43 关联交易

7.44 关联交易

7.45 关联交易

7.46 关联交易

7.47 关联交易

7.48 关联交易

7.49 关联交易

7.50 关联交易

7.51 关联交易

7.52 关联交易

7.53 关联交易

7.54 关联交易

7.55 关联交易

7.56 关联交易

7.57 关联交易

7.58 关联交易

7.59 关联交易

7.60 关联交易

7.61 关联交易

7.62 关联交易

7.63 关联交易

7.64 关联交易

7.65 关联交易

7.66 关联交易

7.67 关联交易

7.68 关联交易

7.69 关联交易

7.70 关联交易

7.71 关联交易

7.72 关联交易

7.73 关联交易

7.74 关联交易

7.75 关联交易

7.76 关联交易

7.77 关联交易

7.78 关联交易

7.79 关联交易

7.80 关联交易

7.81 关联交易

7.82 关联交易

7.83 关联交易

7.84 关联交易

7.85 关联交易

7.86 关联交易

7.87 关联交易

7.88 关联交易

7.89 关联交易

7.90 关联交易

7.91 关联交易

7.92 关联交易

7.93 关联交易

7.94 关联交易

7.95 关联交易

7.96 关联交易

7.97 关联交易

7.98 关联交易

7.99 关联交易

7.100 关联交易

7.101 关联交易

7.102 关联交易

7.103 关联交易

7.104 关联交易

7.105 关联交易

7.106 关联交易

7.107 关联交易

7.108 关联交易

7.109 关联交易

7.110 关联交易

7.111 关联交易

7.112 关联交易

7.113 关联交易

7.114 关联交易

7.115 关联交易

7.116 关联交易

7.117 关联交易

7.118 关联交易

7.119 关联交易

7.120 关联交易

7.121 关联交易

7.122 关联交易

7.123 关联交易

7.124 关联交易

7.125 关联交易

7.126 关联交易

7.127 关联交易

7.128 关联交易

7.129 关联交易

7.130 关联交易

7.131 关联交易

7.132 关联交易

7.133 关联交易

7.134 关联交易

7.135 关联交易

7.136 关联交易

7.137 关联交易

7.138 关联交易

7.139 关联交易

7.140 关联交易

7.141 关联交易

7.142 关联交易

7.143 关联交易

7.144 关联交易

7.145 关联交易

7.146 关联交易

7.147 关联交易

7.148 关联交易

7.149 关联交易

7.150 关联交易

证券代码:600466

证券简称:迪康药业

编号:临 2007-011 号

四川迪康科技药业股份有限公司关于股票交易异常波动暨传闻澄清公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

公司股票在 2007 年 3 月 20 日、21 日和 22 日连续三个交易日内收盘价格涨幅偏离值累计达到 20% 以上,且近日公司接到股民打来的咨询电话,称“在新浪网站财经纵横栏目、东方财富网股吧等网络媒体中刊登了一些关于公司向美国辉瑞定向增发、中力投资及华泰证券向公司借壳”等重组消息,现公司针对上述股票交易异常及市场传闻,特作如下澄清:

1. 公司已向大股东四川迪康产业控股集团股份有限公司及公司实际控

制人曾雁鸣先生进行了求证,大股东及曾雁鸣先生就上述传闻向公司出具了书面的《声明》,确认以上消息为不实传闻,目前大股东没有与上述公司有过任何接触,也不存在任何与上述公司进行接触的可能;除上述事项外,公司大股东及实际控制人目前亦未与任何谈判方就重组事宜达成意向,不存在应披露而未披露的事实;

2. 公司已于 2007 年 1 月 31 日在《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及上海证券交易所网站上刊登了《业绩修正修正公告》,预计公司 2006 年度净利润较上年同期增加亏损 50% 以上,公司股票交易将被实行退

市风险警示,股票简称前冠以“*ST”字样;

3. 截止公告之日,公司生产经营正常,尚没有重大业绩提升,且面临多起借款纠纷及法律诉讼,2007 年继续亏损,公司股票将面临退市风险,公司董事会再次提醒广大投资者理性投资,注意投资风险。

特此公告

四川迪康科技药业股份有限公司董事会

2007 年 3 月 23 日

申购金额(M)	申购费率
M < 100 万	1.50%
100 万 ≤ M < 500 万	0.70%
M ≥ 500 万	每笔 1000 元