泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金 2006 年年度报告摘要

(上接 D48 版)

卖出股票于成交日确认股票差价收入 /(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(ii) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资;买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账,其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资,后于权证实际取得日按本会计报表附注 3(e)(iii)中所示的方法单独核算权证成本,并相应调整债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入 /(损失);卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入 /(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii) 权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量;买入权证于成交日确认为权证投资,相应成本按成交日应支付的全部价款入账。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日,按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。本基金至今尚未发生主动投资权证的交易。

卖出权证于成交日确认权证差价收入 /(损失),出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(f) 收入 /(损失)的确认和计量

股票差价收入 /(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入 /(损失)于卖出成交日确认;银行间同业市场交易的债券差价收入 /(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入 /(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入 /(损失)于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

除银行次级债之外的债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,银行次级债利息收入按债券票面价值与全额票面利率计算的金额确认,资产支持证券利息收入按凭证票面价值与基金管理人预期的收益率计算的金额确认。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率,在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(g) 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率,在回购期限内采用直线法逐日计提。

(h) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

(i)未实现利得 /(损失)

未实现利得 /(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值 /(减值)和未实现利得 /(损失)平准金。

未实现利得 /(损失)平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未实现利得 /(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得 /(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(j) 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益 /(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配基金净收益 /(累计基金净损失)。

(k) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日前一日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金当期收益先弥补以前年度亏损后,方可进行当期收益分配。基金当年亏损,则不进行收益分配。在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至少分配一次,基金收益分配比例不低于基金年度净收益的 90%。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

2、本报告期泰达荷银周期基金没有重大会计差错和更正金额

3、重大关联方关系及关联交易

(a) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰达荷银基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
荷银投资管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
北方国际信托投资股份有限公司	基金管理人的股东
湘财证券有限责任公司("湘财证券")	基金管理人的原股东、基金代销机构

根据泰达荷银基金管理有限公司于 2006 年 4 月 27 日发布的公告,经 2005 年第五次股东会审议通过,报中国证监会批准(证监基金字[2006]64 号文),湘财证券有限责任公司分别将其持有的湘财荷银基金管理有限公司 67%股权转让给荷银投资管理(亚洲)有限公司 16%,北方国际信托投资股份有限公司 51%。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(b) 通过关联方湘财证券席位进行的证券交易及交易佣金

	2006年度	
	成交量	占本年成交量的比例
湘财证券:		
买卖股票	619,397,425.04	27.55%
买卖债券	104,669,626.30	50.13%
买卖权证	1,306,155.04	27.37%
回购	97,000,000.00	63.39%
	佣金	占本年佣金总量的比例
湘财证券	505,997.79	27.95%
	2005年度	
	成交量	占本年成交量的比例
湘财证券:		
买卖股票	419,411,784.27	28.71%
买卖债券	80,323,484.30	37.56%
买卖权证	526,457.50	27.34%
回购	74,000,000.00	32.08%
	佣金	占本年佣金总量的比例
湘财证券	342,390.17	29.14%

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务

(c)基金管理人报酬

支付基金管理人泰达荷银基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 3,942,490.80 元(2005 年:3,903,731.06 元)。

(d)基金托管费

支付基金托管人交通银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 657,081.87 元(2005 年:650,621.77 元)。

(e) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 1,996,035.46 元(2005 年:20,615,777.51 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 30,304.42 元(2005 年:111,502.67 元)。

本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于 2006 年 12 月 31 日的相关余额 1,303,192.79 元计入"结算备付金"科目(2005 年:798,241.02 元)。

(f)本基金管理公司、本基金管理公司主要股东及其控制的机构在最近两个年度均未持有本基金。

4、流通受限制不能自由转让的基金资产

(a) 基金可使用以基金名义开设的股票账户,比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止,因上述原因投资的流通受限制的股票情况如下:

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	申购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
600761	安徽合力	2006/07/06	2007/07/06	10.60	22.25	500,000.00	5,300,000.00	11,125,000.00
合计							5,300,000.00	11,125,000.00

(b) 截至 2006 年 12 月 31 日,本基金持有以下因未能按交易所信息披露的有关要求按时披露重要信息或因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,这些股票将在重要信息披露完成后或所公布事项的重大影响消除后并经交易所批准后复牌。

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
600875	东方电机	2006/12/20	27.10	尚未公布	尚未公布	295,114.00	6,843,601.91	7,997,589.40

泰达荷银价值优化型行业类别证券投资基金

泰达荷银价值优化型稳定类证券投资基金

2006 年 12 月 31 日资产负债表

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

	附注	2006年12月31日	2005年12月31日
资产			
银行存款	18(e)	4,213,234.34	2,862,561.24
结算备付金	5,18(e)	5,868,710.01	2,336,810.42
交易保证金	5	359,609.61	881,465.52
应收证券清算款		–	6,112,916.29
应收利息	6	368,159.59	705,726.74
应收申购款		–	10,217.00
股票投资市值		256,429,736.92	177,992,302.29
其中:股票投资成本		223,127,542.89	164,812,828.19
债券投资市值		65,132,795.25	84,624,279.14
其中:债券投资成本		65,080,778.00	84,459,460.28
权证投资		0	0
其中:权证投资成本		0	0
资产总计		332,372,245.72	275,526,278.64
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		6,042,843.17	–
应付赎回款		575,101.93	51,784.82
应付赎回费		302.55	15.29
应付管理人报酬		376,739.63	348,524.73
应付托管费		62,789.95	58,087.47
应付佣金	7	724,741.83	472,316.51
应付利息		–	4,530.72
其他应付款	8	750,000.00	750,000.00
卖出回购证券款		–	30,000,000.00
预提费用	9	50,000.00	50,000.00
负债合计		8,582,519.06	31,735,259.54
持有人权益			
实收基金	10	140,258,776.64	237,290,554.72
未实现利得 /(损失)	11	11,943,622.05	8,387,900.25
未分配基金净收益 /(累计基金净损失)		171,587,327.97	(1,887,435.87)
持有人权益合计		323,789,726.66	243,791,019.10
(2006 年末基金份额资产净值:2.3085 元)			
(2005 年末基金份额资产净值:1.0274 元)			
负债及持有人权益总计		332,372,245.72	275,526,278.64

泰达荷银价值优化型行业类别证券投资基金

泰达荷银价值优化型稳定类证券投资基金

2006 年度经营业绩表

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

	附注	2006年度	2005年度
收入			
股票差价收入 /(损失)	12	218,015,900.61	(7,146,630.38)
债券差价收入 /(损失)	13	(160,972.35)	1,191,733.25
权证差价收入	14	2,518,476.56	–
债券利息收入		1,478,917.97	2,091,306.24
存款利息收入		169,745.16	301,734.19
股利收入		1,893,483.62	4,972,600.53
其他收入	15	102,503.09	262,857.25
收入合计		224,018,054.66	1,673,601.08
费用			
基金管理人报酬	18(c)	(4,130,804.84)	(5,359,047.56)
基金托管费	18(d)	(688,467.48)	(893,174.60)
卖出回购证券支出		(221,633.98)	(112,549.04)
其他费用	16	(183,461.07)	(188,321.09)
其中:信息披露费		(100,000.00)	(106,666.67)
审计费用		(50,000.00)	(50,000.00)
费用合计		(5,224,367.37)	(6,553,092.29)
基金净收益 /(损失)		218,793,687.29	(4,879,491.21)
加:未实现估值增值 /(减值)变动数	11	20,009,918.32	31,068,863.35
基金经营业绩		238,803,605.61	26,189,372.14
基金净收益 /(损失)		218,793,687.29	(4,879,491.21)
加:年初基金净收益		(1,887,435.87)	17,166,352.36
本年申购基金份额的损益平准金		26,580,914.10	(2,284,244.53)
本年赎回基金份额的损益平准金		(60,948,382.79)	1,782,970.40
可供分配基金净收益		182,538,782.73	11,785,587.02
减:本年已分配基金净收益	17	(10,951,454.76)	(13,673,022.89)
未分配基金净收益		171,587,327.97	(1,887,435.87)

泰达荷银价值优化型行业类别证券投资基金

泰达荷银价值优化型稳定类证券投资基金

2006 年度基金净值变动表

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

	2006年度	2005年度
年初基金净值	243,791,019.10	407,798,879.41
本年经营活动		
基金净收益 /(损失)	218,793,687.29	(4,879,491.21)
未实现估值增值 /(减值)变动数	20,009,918.32	31,068,863.35
经营活动产生的基金净值变动数	238,803,605.61	26,189,372.14
本期基金份额交易		
基金申购款	148,235,128.93	118,385,831.31
其中:分红再投资	772,485.37	1,065,672.87
基金赎回款	(296,088,572.22)	(294,910,040.87)
基金份额交易产生的基金净值变动数	(147,853,443.29)	(176,524,209.56)
本年向基金份额持有人分配收益		
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	(10,951,454.76)	(13,673,022.89)
年末基金净值	323,789,726.66	243,791,019.10

泰达荷银价值优化型行业类别证券投资基金

泰达荷银价值优化型稳定类行业证券投资基金

2005 年度会计报表附注

(除特别标明外,金额单位为人民币元)

1、本年度主要会计政策和会计估计:

(a) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

(b) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(c) 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外,所有报表项目均以历史成本计价。

(d) 基金资产的估值原则

(i) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票,按成本估值;由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;2006 年 11 月 13 日之前由定向增发形成的暂时流通受限制的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于定向增发股票的初始成本,按市场交易收盘价估值,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于定向增发股票的初始成本,按两者差价在定向增发股票锁定期的摊销金额与初始成本之和估值。

(ii) 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的的净价估值。

银行间同业市场的交易和未上市流通的债券按成本估值。

(iii)权证投资

从获赠确认日、买入成交确认日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出日或行权日止,上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值;未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

(iv)实际投资成本与估值的差异计入"未实现利得 /(损失)"科目。

(V) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值,本基金的基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(e) 证券投资基金成本计价方法

(i) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价时冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入 /(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(ii) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资;买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账,其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资,后于权证实际取得日按本会计报表附注 3(e)(iii)中所示的方法单独核算权证成本,并相应调整债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入 /(损失);卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入 /(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii) 权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量;买入权证于成交日确认为权证投资,相应成本按成交日应支付的全部价款入账。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日,按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。本基金至今尚未发生主动投资权证的交易。

卖出权证于成交日确认权证差价收入 /(损失),出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(f) 收入 /(损失)的确认和计量

股票差价收入 /(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入 /(损失)于卖出成交日确认;银行间同业市场交易的债券差价收入 /(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入 /(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入 /(损失)于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

除银行次级债之外的债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,银行次级债利息收入按债券票面价值与全额票面利率计算的金额确认,资产支持证券利息收入按凭证票面价值与基金管理人预期的收益率计算的金额确认。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率,在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(g) 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率,在回购期限内采用直线法逐日计提。

(h) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

(i) 未实现利得 /(损失)

未实现利得 /(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值 /(减值)和未实现利得 /(损失)平准金。

未实现利得 /(损失)平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益 /(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得 /(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(j)损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益 /(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配基金净收益 /(累计基金净损失)。

(k)基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日前一日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金当期收益先弥补以前年度亏损后,方可进行当期收益分配。基金当年亏损,则不进行收益分配。在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至少分配一次,基金收益分配比例不低于基金年度净收益的 90%。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

2、本报告期泰达荷银稳定基金没有重大会计差错和更正金额。

3、重大关联方关系及关联交易

(a) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰达荷银基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
荷银投资管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
北方国际信托投资股份有限公司	基金管理人的股东
湘财证券有限责任公司("湘财证券")	基金管理人的原股东、基金代销机构

根据泰达荷银基金管理有限公司于 2006 年 4 月 27 日发布的公告,经 2005 年第五次股东会审议通过,报中国证监会批准(证监基金字[2006]64 号文),湘财证券有限责任公司分别将其持有的湘财荷银基金管理有限公司 67%股权转让给荷银投资管理(亚洲)有限公司 16%,北方国际信托投资股份有限公司 51%。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(b) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

	2006年度	
	成交量	占本年成交量的比例
湘财证券:		
买卖股票	418,011,555.49	16.47%
买卖债券	43,621,904.00	38.52%
买卖权证	0.00	0.00%
买卖回购	46,000,000.00	29.68%
	佣金	占本年佣金总量的比例
湘财证券	333,810.79	16.25%
	2005年度	
	成交量	占本年成交量的比例
湘财证券:		
买卖股票	628,327,582.67	26.78%
买卖债券	60,550,934.90	21.18%
买卖权证	0.00	0.00%
买卖回购	28,000,000.00	23.99%
	佣金	占本年佣金总量的比例
湘财证券	501,388.25	26.41%

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(c) 基金管理人报酬

支付基金管理人泰达荷银基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 4,130,804.84 元(2005 年:5,359,047.56 元)。

(d) 基金托管费

支付基金托管人交通银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 688,467.48 元(2005 年:893,174.60 元)。

(e) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 4,213,234.34 元(2005 年:2,862,561.24 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 52,661.22 元(2005 年:142,394.69 元)。

本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于 2006 年 12 月 31 日的相关余额 5,868,710.01 元计入"结算备付金"科目(2005 年:2,336,810.42 元)。

(f)本基金管理公司、本基金管理公司主要股东及其控制的机构在最近两个年度均未持有本基金。

4、流通受限制不能自由转让的基金资产

基金可使用以基金名义开设的股票账户,比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止,因上述原因投资的流通受限制的股票情况如下:

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	申购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
601988	中国银行	2006/06/28	2007/01/05	3.08	5.43	306,520.00	944,081.60	1,664,403.60
600761	安徽合力	2006/07/06	2007/07/06	10.60	22.25	500,000.00	5,300,000.00	11,125,000.00
合计							6,244,081.60	12,789,403.60

八、投资组合报告

合丰成长基金

(一)报告期末基金资产组合(单位:元)

项目	金额	占基金总资产比例
股票	479,366,949.85	73.60%
债券	127,178,595.50	19.53%
权证	0	0
银行存款和清算备付金	42,546,769.81	6.53%
其它资产	2,255,416.74	0.34%
合计	651,347,731.90	100.00%

(二)本报告期末按行业分类的股票投资组合(单位:元)

行业分类	市值	占基金净值比例
A 农、林、牧、渔业	26,250,000.00	4.15%
B 采掘业		
C 制造业	266,474,020.94	42.14%
C0 食品、饮料	12,051,394.86	1.91%
C1 纺织、服装、皮毛		
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料	14,492,274.32	2.29%
C5 电子	36,092,563.38	5.71%
C6 金属、非金属		
C7 机械、设备、仪表	136,580,948.52	21.60%
C8 医药、生物制品	35,967,311.70	5.69%
C99 其他制造业	31,289,528.16	4.95%
D 电力、煤气及水的生产和供应业		
E 建筑业		
F 交通运输、仓储业		
G 信息技术业	127,760,642.01	20.20%
H 批发和零售贸易	6,927,000.00	1.10%
I 金融、保险业		
J 房地产业		
K 社会服务业		
L 传播与文化产业	51,955,286.90	8.22%
M 综合类		
合计	479,366,949.85	75.81%

本基金投资成长类行业股票市值合计占投资股票总市值的 84.91%。

(三)本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细(单位:元)

股票代码	股票名称	数 量	市 值	市值占净值比
600037	歌华有线	2089915	51,955,286.90	8.22%
000063	中兴通讯	1299819	50,822,922.90	8.04%
002025	航天电器	1798334	36,092,563.38	5.71%
000768	西飞国际	2999931	35,099,192.70	5.55%
600206	有研硅股	2788728	31,289,528.16	4.95%
002028	思源电气	900000	26,919,000.00	4.26%
000829	赣南果业	1250000	26,250,000.00	4.15%
000157	中联重科	899928	20,005,399.44	3.16%
600797	浙大网新	2999912	19,469,428.88	3.08%
600031	三一重工	600000	19,338,000.00	3.06%
002007	华兰生物	799982	18,399,586.00	2.91%
000623	吉林敖东	530747	17,567,725.70	2.78%
600312	平高电气	999972	14,969,580.84	2.37%
600299	星新材料	792794	14,492,274.32	2.29%
600271	航天信息	399926	14,001,409.26	2.21%
600485	中创信测	999920	12,858,971.20	2.03%
600410	华胜天成	500000	12,430,000.00	1.97%
600195	中牧股份	1013574	12,051,394.86	1.91%
600761	安徽合力	500000	11,125,000.00	1.76%
002052	同洲电子	474969	9,922,102.41	1.57%
002065	东华合创	299993	8,255,807.36	1.31%
600361	华联综超	300000	6,927,000.00	1.10%
600582	S天地	249991	6,234,775.54	0.99%
600786	S东锅	100000	2,890,000.00	0.46%

1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比例
000063	中兴通讯	165,502,075.66	26.56%
600037	歌华有线	97,264,614.89	15.61%
600050	中国联通	75,042,586.62	12.04%
600406	国电南瑞	68,562,921.56	11.00%
600485	中创信测	65,407,775.18	10.49%
002025	航天电器	63,721,907.03	10.22%
000768	西飞国际	61,663,603.56	9.89%
002028	思源电气	48,082,804.09	7.72%
002049	晶源电子	45,604,798.46	7.32%
002007	华兰生物	41,941,096.47	6.73%
600276	恒瑞医药	41,458,021.72	6.65%
600410	华胜天成	39,791,255.21	6.38%
600797	浙大网新	39,523,516.54	6.34%
600183	生益科技	39,472,119.30	6.33%
000423	S 阿 胶	39,318,900.51	6.31%
600582	S天地	36,819,938.15	5.91%
000157	中联重科	35,514,148.59	5.70%
002065	东华合创	32,755,533.82	5.26%
600312	平高电气	32,079,533.14	5.15%
600206	有研硅股	29,989,426.42	4.81%
600511	国药股份	29,949,477.69	4.81%
600879	火箭股份	28,745,346.02	4.61%
000069	华侨城 A	28,743,219.05	4.61%
600360	华微电子	28,414,388.35	4.56%
600261	浙江阳光	28,070,561.23	4.50%
600271	航天信息	27,864,436.05	4.47%
600529	山东药玻	25,310,036.93	4.06%
000538	云南白药	25,019,898.88	4.01%
600201	金宇集团	23,905,408.66	3.84%
000829	赣南果业	23,895,681.72	3.83%
600122	宏图高科	23,768,010.49	3.81%
600563	法拉电子	23,718,707.32	3.81%
600875	东方电机	23,645,534.26	3.79%
600028	中国石化	23,363,941.27	3.75%
600718	东软股份	22,858,506.96	3.67%
600330	天通股份	21,759,790.44	3.49%
000402	金 融 街	20,066,751.88	3.22%
600594	益佰制药	20,011,321.90	3.21%
002052	同洲电子	19,724,207.37	3.16%
000917	电广传媒	19,414,458.07	3.12%
000400	许继电气	18,804,222.59	3.02%
002008	大族激光	18,154,246.23	2.91%
600299	星新材料	17,280,902.06	2.77%
600031	三一重工	17,278,661.07	2.77%
600755	厦门国贸	17,264,991.12	2.77%
000533	S 万家乐	16,898,943.66	2.71%
600880	博瑞传播	16,381,007.79	2.63%
600416	湘电股份	15,952,331.56	2.56%
600220	江苏阳光	15,692,200.59	2.52%
000623	吉林敖东	15,631,007.60	2.51%
600521	华海药业	15,009,368.25	2.41%
600026	中海发展	14,232,570.67	2.28%
000858	五 粮 液	13,489,424.10	2.16%
600481	双良股份	13,432,366.57	2.16%

2、报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初净值比例
000063	中兴通讯	176,916,009.44	28.39%
600037	歌华有线	109,950,608.95	17.64%
600050	中国联通	109,519,190.40	17.57%
600406	国电南瑞	91,754,075.27	14.72%
600271	航天信息