

博时裕富证券投资基金

2006年年度报告摘要

重要提示

基金管理人的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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人承诺以诚实信用、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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

调整，对基金份额持有人利益造成损害。博时裕富证券投资基金年度报告编制，并经基金托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

五、审计报告

普华永道中天会计师事务所(以下简称“普华永道”)审计了博时裕富证券投资基金(以下简称“博时裕富基金”)的资产负债表、利润表、所有者权益变动表及财务报表附注。

一、管理层对会计报表的责任
按照企业会计准则、《金融企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》、《博时裕富证券投资基金合同》和中国证监会颁布的基金管理业务操作的相关规定编制会计报表是博时裕富基金的管理人博时基金管理有限公司管理层的责任。

二、注册会计师的责任
我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。

三、审计意见
我们认为，上述会计报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》、《博时裕富证券投资基金合同》和中国证监会颁布的基金管理业务操作的相关规定编制，在所有重大方面公允反映了博时裕富基金2006年12月31日的财务状况以及2006年度的经营成果和基金净值变动情况。

四、注册会计师
普华永道中天会计师事务所有限公司
汪 楷 注册会计师
陈 宇 注册会计师

中国·上海市
2007年3月26日

六、财务会计报告

(一)基金年度会计报表
博时裕富证券投资基金资产负债表

单位:人民币元

Table with 3 columns: Item, 2006年12月31日, 2005年12月31日. Rows include 银行存款, 清算净值, 交易保证金, etc.

(二)基金净值表现
本报告期主要财务指标

Table with 4 columns: 2006年, 2005年, 2004年. Rows include 基金本期净值增长率, 基金份额净值增长率, etc.

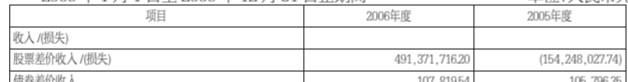
上述财务指标采用的计算公式、详见中国证监会颁布的证券投资基金信息披露编报规则第1号《主要财务指标的披露》。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如开放式基金的申购赎回费、基金转换费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

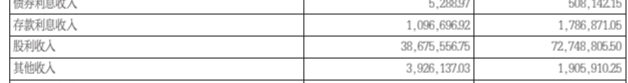
(三)基金净值表现
1. 列示于下一表格的基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 期, 1, 2, 3, 4. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, etc.

2. 图示自基金合同生效以来基金净值表现的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较



3. 图示基金过往三年每年的净值增长率，并与同期业绩比较基准的收益率进行比较



4. 基金业绩比较基准的构建以及再平衡过程
基金业绩比较基准由新华富时中国A200指数由新华富时指数公司构建和发布。

(三)基金过往三年每年的收益分配情况

Table with 3 columns: 会计期间, 每10份基金份额分红, 备注. Rows include 2006年度, 2005年度, etc.

三、管理人报告

(一)基金管理人及基金简介
1. 基金管理人简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。

2. 基金简介
博时裕富证券投资基金(以下简称“博时裕富”)经中国证监会证监基金字[2006]107号文批准设立。

(二)本报告期基金净值表现
在本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金会计核算办法》及其各项实施细则、《博时裕富证券投资基金合同》及其他相关法律法规的规定。

(三)本报告期基金的投资策略和业绩表现
博时裕富投资于2003年8月26日，从2005年12月31日到2006年12月31日，基金份额净值增长率为120.74%，同期业绩比较基准的涨幅为115.42%。

(四)本报告期基金的投资组合报告
截至2006年12月31日，博时裕富证券投资基金资产净值为1,662,189,900.02元。

(五)本报告期基金的风险控制
本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资比例进行投资。

(六)本报告期基金的费用
本报告期基金管理人按照基金合同约定计提了各项费用。

(七)本报告期基金的业绩评价
本基金管理人认为，本报告期基金的投资运作符合基金合同约定。

(八)本报告期基金的未来展望
本基金管理人将对市场进行持续跟踪，力争为基金份额持有人创造长期稳定的回报。

(九)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(十)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(十一)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(十二)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(十三)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(十四)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(十五)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(十六)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(十七)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(十八)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(十九)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(二十)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(二十一)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(二十二)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(二十三)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(二十四)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(二十五)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(二十六)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(二十七)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(二十八)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(二十九)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(三十)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(三十一)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(三十二)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(三十三)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(三十四)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(三十五)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(三十六)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(三十七)本报告期基金的其他重要事项
本报告期基金管理人无其他重大事项需要披露。

(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，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。

(f)证券投资基本成本计价方法
(i)股票投资
买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按交易日支付的全部价款扣除佣金。

(ii)债券投资
买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按交易日支付的全部价款扣除佣金。

(iii)权证投资
买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按交易日支付的全部价款扣除佣金。

(iv)其他投资
买入其他投资于成交日确认为其他投资。其他投资成本按交易日支付的全部价款扣除佣金。

(v)公允价值
公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售资产或转移负债的价格。

(vi)估值程序
估值程序是指基金管理人根据基金合同、基金招募说明书及相关法律法规的规定，对基金资产进行估值。

(vii)估值错误
估值错误是指基金管理人或其委托的估值机构在估值过程中出现的差错。

(viii)估值调整
估值调整是指基金管理人根据估值错误处理原则对估值结果进行的调整。

(ix)估值复核
估值复核是指基金托管人对基金管理人估值结果的复核。

(x)估值披露
估值披露是指基金管理人按照基金合同约定披露基金资产净值和基金份额净值。

(xi)估值档案
估值档案是指基金管理人保存的估值相关资料。

(xii)估值责任
估值责任是指基金管理人及其委托的估值机构对估值结果的法律责任。

(xiii)估值争议
估值争议是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中发生的争议。

(xiv)估值终止
估值终止是指基金管理人及其委托的估值机构停止估值的情况。

(xv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xvi)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xvii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xviii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xix)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xx)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxi)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxiii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxiv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxvi)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxvii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxviii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxix)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxx)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxxi)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxxii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxxiii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxxiv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxxv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxxvi)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxxvii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxxviii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xxxix)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xl)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xli)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xliii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xliv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlvi)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlvii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlviii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlvix)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xl)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xli)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xliii)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xliv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

(xlv)估值其他
估值其他是指基金管理人及其委托的估值机构在估值过程中涉及的其他事项。

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额(元), 占期末基金资产净值的比例. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

注:000866 杨子石化已于2006年4月1日终止上市。

3. 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的成本总额

Table with 2 columns: 买入股票的成本总额, 卖出股票的成本总额. Values: 615,888,094.80, 3,241,705,732.22

(五)报告期末按持仓分拆的债券投资组合
本报告期末，本基金未持有债券。

(六)报告期末按持仓分拆的基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细
本报告期末，本基金未持有债券。

(七)投资组合报告附注
1. 报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2. 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定投资范围之外的股票。

3. 其他重要事项
本报告期末，本基金未持有债券。

4. 本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5. 本基金报告期末未持有资产支持证券。

6. 本基金报告期末持有的分离交易可转债的明细

Table with 3 columns: 序号, 名称, 数量, 成本总额(元). Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

7. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

8. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

9. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

10. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

11. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

12. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

13. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

14. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

15. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

16. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

17. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

18. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

19. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

20. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

21. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

22. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

23. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

24. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

25. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

26. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表

Table with 4 columns: 申购赎回日期, 申购赎回份额, 申购赎回金额, 申购赎回费率. Rows include 1, 2, 3, 4, 5, etc.

27. 本基金报告期内被申购赎回的基金份额
申购赎回的基金份额明细表