

广发策略优选混合型证券投资基金 2006年年度报告摘要

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

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...

一、基金简介
(一)基金基本情况
基金名称:广发策略优选混合型证券投资基金
基金简称:广发优选
基金代码:270006

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
注册地址:广东省珠海市凤凰北路19号广发大厦1208室
办公地址:广州市天河区体育西路17号红荔大厦14、15楼

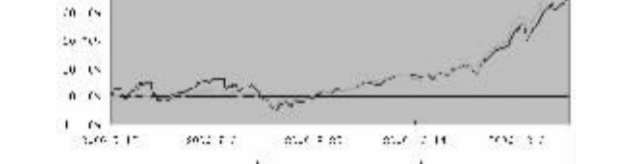
二、主要财务数据和基金净值表现
(一)主要财务指标

Table with 2 columns: Item (项目) and Value (2006年5月17日至2006年12月31日). Rows include Net Income, Net Assets, etc.

注:本基金合同于2006年5月17日生效,自基金合同生效以来至被审计期末一年,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...

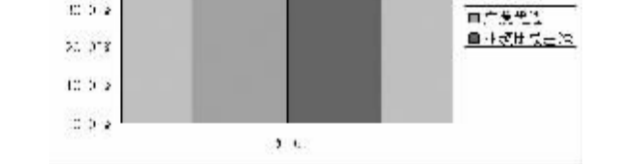
Table with 4 columns: Period (阶段), Net Growth Rate (净值增长率), Benchmark (业绩比较基准), Difference (与基准的差额). Rows for 3 months, 6 months, and 1 year.

2. 本基金自基金合同生效以来基金净值的增长率与同期业绩比较基准收益率比较图



注:1.业绩比较基准:75%\*新华富时A600指数+25%\*新华富时中国全债指数
2.本基金自基金合同生效以来至被审计期末一年...

3. 本基金自基金合同生效以来至被审计期末一年业绩比较基准收益率比较图



4. 本基金每年的基金收益分配情况

三、管理人报告
(一)基金管理人及基金基本情况

广发基金管理有限公司
注册地址:广东省珠海市凤凰北路19号广发大厦1208室
办公地址:广州市天河区体育西路17号红荔大厦14、15楼

四、基金投资组合报告
(一)基金投资组合情况

截至2006年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资: 1,197,474,714.62元, 占基金资产净值的61.96%

(二)基金投资组合报告
1. 基金投资组合情况

截至2006年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资: 1,197,474,714.62元, 占基金资产净值的61.96%

五、审计报告
基金管理人于2006年12月31日,聘请了具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所,对基金管理人于2006年12月31日的财务报表进行了审计...

六、基金财务报表
(一)资产负债表

Balance Sheet table for December 31, 2006. Columns: Asset (资产), Liability (负债), and Equity (所有者权益). Rows include Cash, Securities, etc.

经营业绩表
(2006年5月17日至2006年12月31日期间)
金额单位:人民币元

Income Statement table for 2006. Columns: Item (项目), Note (附注), and Amount (2006年5月17日至2006年12月31日). Rows include Interest Income, Investment Income, etc.

收益分配表
(2006年5月17日至2006年12月31日期间)
金额单位:人民币元

Distribution Statement table for 2006. Columns: Item (项目), Note (附注), and Amount (2006年5月17日至2006年12月31日). Rows include Dividend Income, etc.

基金净值变动表
(2006年5月17日至2006年12月31日期间)
金额单位:人民币元

Net Asset Value Change table for 2006. Columns: Item (项目), Note (附注), and Amount (2006年5月17日至2006年12月31日). Rows include Net Income, Net Assets, etc.

(二)会计报表附注
1. 主要会计政策
(1) 会计年度:公历1月1日至12月31日

(2) 记账本位币:人民币
(3) 记账基础和计价原则:本基金会计核算以权责发生制为记账基础,除股票投资和债券投资及权证投资按本附注所述的估值方法计价外,其他所有报表项目均按历史成本计价

(4) 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,出售一项资产所能收到的价格。公允价值计量时,本基金管理人将优先使用可观察到的输入值,只有在无法取得可观察到的输入值或取得可靠的可观察到的输入值成本过高时,才会使用不可观察到的输入值

(5) 金融资产估值:股票投资估值:以估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,按最近交易日的市价估值;未上市交易的股票,按最近交易日的市价估值;估值日无交易的,按最近交易日的市价估值

(6) 债券投资的成本计价方法:债券投资的成本计价方法:按买入价扣除佣金和印花税后的净额,加上相关费用后的净额,扣除利息收入和公允价值变动后的净额

(7) 权证估值:权证投资的成本计价方法:按买入价扣除佣金和印花税后的净额,加上相关费用后的净额,扣除利息收入和公允价值变动后的净额

(8) 应收利息:应收利息是指基金持有的有价证券应收利息,按票面利率和面值计算,并于付息日确认

(9) 基金收益分配:基金收益分配是指基金收益扣除各项费用后的余额,按基金合同的规定进行分配

(10) 基金收益分配:基金收益分配是指基金收益扣除各项费用后的余额,按基金合同的规定进行分配

(11) 关联方:关联方是指与本基金存在直接或间接关系的自然人、法人或其他组织

Table of Related Parties (关联方). Columns: Party Name (关联方), Relationship (与本基金的关系), and Shareholding (持股比例). Rows include GFAMC, ICBC, etc.

股票交易佣金的计提标准:支付佣金=股票成交金额\*佣金比例-证管费-经手费-结算风险金(含印花税)

上述佣金按市场佣金率计算,佣金比例是公允的。根据《证券服务协议》,本基金管理人从关联方获得证券研究综合服务。根据《证券服务协议》,本基金管理人从关联方获得证券研究综合服务

(六) 关联方持有的基金份额
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。

Table of Shareholdings (关联方持有的基金份额). Columns: Party Name (关联方), Shares (数量), and Amount (金额). Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(七) 关联方持有的基金份额
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。

Table of Shareholdings (关联方持有的基金份额). Columns: Party Name (关联方), Shares (数量), and Amount (金额). Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(八) 关联方持有的基金份额
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。

Table of Shareholdings (关联方持有的基金份额). Columns: Party Name (关联方), Shares (数量), and Amount (金额). Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(九) 关联方持有的基金份额
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。

Table of Shareholdings (关联方持有的基金份额). Columns: Party Name (关联方), Shares (数量), and Amount (金额). Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(十) 关联方持有的基金份额
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。

Table of Shareholdings (关联方持有的基金份额). Columns: Party Name (关联方), Shares (数量), and Amount (金额). Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(十一) 关联方持有的基金份额
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。

Table of Shareholdings (关联方持有的基金份额). Columns: Party Name (关联方), Shares (数量), and Amount (金额). Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(十二) 关联方持有的基金份额
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。

Table of Shareholdings (关联方持有的基金份额). Columns: Party Name (关联方), Shares (数量), and Amount (金额). Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(十三) 关联方持有的基金份额
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。
截至2006年12月31日,本基金关联方未持有本基金。

(五) 债券种类的债券投资组合

Table of Bond Portfolio. Columns: Bond Type (债券类别), Market Value (债券市值), and Market Value Ratio (市值占净值比). Rows include Government Bonds, etc.

(六) 债券种类的债券投资组合
截至2006年12月31日,本基金持有的债券投资组合如下:

Table of Bond Portfolio. Columns: Bond Code (权证代码), Bond Name (权证名称), Quantity (权证数量), etc. Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(七) 债券种类的债券投资组合
截至2006年12月31日,本基金持有的债券投资组合如下:

Table of Bond Portfolio. Columns: Bond Code (权证代码), Bond Name (权证名称), Quantity (权证数量), etc. Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(八) 债券种类的债券投资组合
截至2006年12月31日,本基金持有的债券投资组合如下:

Table of Bond Portfolio. Columns: Bond Code (权证代码), Bond Name (权证名称), Quantity (权证数量), etc. Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(九) 债券种类的债券投资组合
截至2006年12月31日,本基金持有的债券投资组合如下:

Table of Bond Portfolio. Columns: Bond Code (权证代码), Bond Name (权证名称), Quantity (权证数量), etc. Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(十) 债券种类的债券投资组合
截至2006年12月31日,本基金持有的债券投资组合如下:

Table of Bond Portfolio. Columns: Bond Code (权证代码), Bond Name (权证名称), Quantity (权证数量), etc. Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(十一) 债券种类的债券投资组合
截至2006年12月31日,本基金持有的债券投资组合如下:

Table of Bond Portfolio. Columns: Bond Code (权证代码), Bond Name (权证名称), Quantity (权证数量), etc. Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(十二) 债券种类的债券投资组合
截至2006年12月31日,本基金持有的债券投资组合如下:

Table of Bond Portfolio. Columns: Bond Code (权证代码), Bond Name (权证名称), Quantity (权证数量), etc. Rows include GFAMC, ICBC, etc.

(十三) 债券种类的债券投资组合
截至2006年12月31日,本基金持有的债券投资组合如下: