广发聚丰股票型证券投资基金 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

本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。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年3月21日复核了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,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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

一、基金简介

(一)基金基本资料

基金名称:广发聚丰股票型证券投资基金

基金简称:广发聚丰

基金代码:270005

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2005年12月23日

截止2006年12月31日本基金份额总额:1,470,284,026.01份

投资目标:依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场,通过适时调整价值类和成长类股票的配置比例和股票精选,寻求基金资产长期增值。

投资策略:本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的各类股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金将股票资产分为价值类股票和成长类股票两类风格资产,在两类资产中运用不同的方法分别筛选具有投资价值的股票,同时保持两类资产的适度均衡配置,构建股票投资组合。

业绩比较基准:80%*新华富时A600指数+20%*新华雷曼中国全债指数

风险收益特征:较高风险,较高收益

(二)基金管理人概况

名称:广发基金管理有限公司

注册地址:广东省珠海市凤凰北路19号农行商业大厦1208室

办公地址:广州市天河区体育西路57号红盾大厦14、15楼

邮政编码:510620

成立时间:2003年8月5日

法定代表人:马庆泉

信息披露负责人:兰惠艳

联系电话:020-83936666

传真:020-85586632

电子信箱:lhy@gffunds.com.cn

(三)基金托管人概况

名称:中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

邮政编码:100032

法定代表人:姜建清

信息披露负责人:蒋松云

联系电话:010-66106912

传真:010-66106904

电子邮箱:custody@icbc.com.cn

(四)本基金选定的信息披露报纸:证券时报、上海证券报

此外,投资者还可以通过以下途径查阅本基金年度报告:

查阅地点:广州市体育西路57号红盾大厦14楼

本基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn

二、主要财务指标和基金净值表现

(一)主要财务指标

单位:人民币元

项　目	2006年1月1日--12月31日	2005年12月23日--12月31日
基金本期净收益	839,000,475.82	-250,162.00
基金份额本期净收益(加权)	0.5579	-0.0002
期末可供分配基金收益	523,317,194.73	-250,162.00
期末可供分配基金份额收益	0.3559	-0.0002
期末基金资产净值	3,166,641,417.24	1,315,283,133.56
期末基金份额净值	2.1538	0.9996
基金加权平均净值收益率	36.05%	-0.02%
本期基金份额净值增长率	144.08%	-0.04%
基金份额累计净值增长率	143.98%	-0.04%

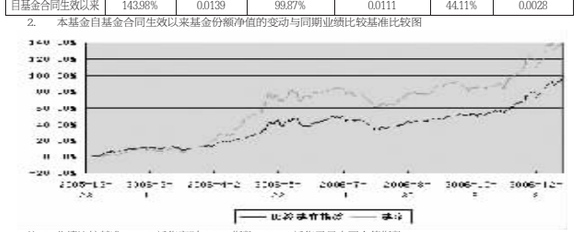
注:本基金基金合同于2005年12月23日生效。

(二)基金净值表现

1.　本基金本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去3个月	28.59%	0.0155	31.35%	0.0112	-2.76%	0.0043
过去6个月	33.49%	0.0138	33.24%	0.0112	0.25%	0.0026
过去一年	144.08%	0.0141	97.54%	0.0112	46.54%	0.0029
自基金合同生效以来	143.98%	0.0139	99.87%	0.0111	44.11%	0.0028

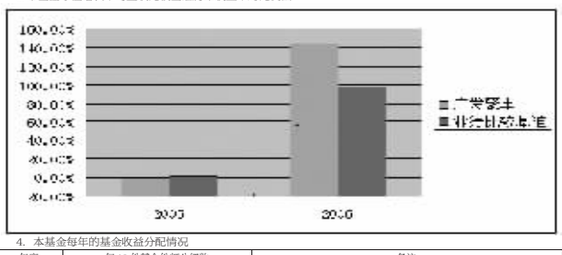
2.　本基金自基金合同生效以来基金份额净值的变动与同期业绩比较基准比较图



注:1.业绩比较基准:80%*新华富时A600指数+20%*新华雷曼中国全债指数

2、本基金基金合同生效日为2005年12月23日,图示时间段为2005年12月23日至2006年12月31日。

3.本基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比例图



4.　本基金每年的基金收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数	备注
2005	0	本基金在2005年度未进行收益分配。
2006	2.00元	本基金2006年度共分红5次,累计每10份分红2.00元
合计	2.00元	

三、管理人报告

(一)基金管理人及基金经理情况:

截至本报告期末,本基金管理人目前旗下管理六只基金:本基金、广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金、广发货币市场基金和广发策略优选混合型证券投资基金。

基金经理情况:

易阳方:男,总经理助理兼投资管理部总经理,经济学硕士,9年证券从业经历,曾任广发证券股份有限公司投资自营部副经理,曾在广发证券股份有限公司投资财务部和投资银行部从事资产管理和投资银行业务。

(二)基金运作合规性声明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套法规、《广发聚富开放式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资管理符合有关法律法规及基金合同的规定。

(三)基金运作及市场情况回顾与展望

1.市场回顾

2006年宏观经济在城镇化进程加快、消费升级、全球制造业向中国转移等因素带动下,进出口高速发展、内需稳步提升、企业利润快速增长,国内经济增长步入中国近代史上前所未有的黄金期。证券市场方面,管理部门成功完成股权分置改革,彻底解决了证券市场发展中的顽症,投资者信心全面恢复。在人民币不断升值和全球性流动性泛滥的推动下,证券市场彻底告别长达5年的熊市,步入牛市周期,全年上证综指从1161.06上涨到2675.47,上涨幅度达到130.43%。

2.基金操作回顾:

本基金在2006年将消费服务、技术装备、稀缺资源作为投资重点,在风格上上半年重点投资在成长风格的股票,下半年根据整体估值水平的变化,适度增持了价值风格的股票。总体看,运作绩效良好,本基金全年基金净值增长144.08%,大大超过比较基准及上证综指的涨幅。

3.展望:

本基金坚信,中国经济正步入一个辉煌的增长时期,产业格局也正在发生巨大变化,由原来劳动力密集型向资本、技术密集型方向转移。在上市公司层面,股权分置改革的成功,推动上市公司治理结构改善,同时由于行业整合等因素推动上市公司整体经营效率提升,上市公司利润增长有望快于GDP增长。值得警惕的是目前流动性泛滥,许多行业估值水平远远超过国际水平,短期风险较大。本基金的投资将业绩增长确定性及估值合理性作为重点考虑因素,重点配置在增长性确定的内需型行业,同时继续加强组合流动性管理,争取在承受适度风险前提下取得较好的业绩。

四、托管人报告

2006年度,本基金托管人在对广发聚丰股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

2006年度,广发聚丰股票型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发聚丰股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对广发基金管理有限公司在2006年度所编制和披露的广发聚丰股票型证券投资基金年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2007年3月6日

五、审计报告

本基金2006年度的财务会计报告由深圳鹏城会计师事务所审计,注册会计师出具了深鹏所审字[2007]224号"无保留意见的审计报告"。

六、财务会计报告

(一)基金会计报表

资产负债表(2006年12月31日)

金额单位:人民币元

资　产	附注	2006-12-31	2005-12-31
资产:			
银行存款		192,338,944.51	910,505,098.02
清算备付金		5,748,153.94	-
交易保证金		750,000.00	250,000.00
应收证券款		28,952,060.31	-
应收股利		-	-
应收利息	4(1)	42,114.06	254,566.66
应收申购款		9,975,053.01	-
其他应收款	4(2)	21,000,000.00	-
股票投资市值	4(3)	2,872,931,135.25	455,399,092.90
其中:股票投资成本		1,878,001,932.79	455,721,822.30
债券投资市值		-	-
其中:债券投资成本		-	-
权证投资市值	4(3)	85,648,142.73	-
其中:权证投资成本		51,974,951.08	-
买入返售证券			
待摊费用			0.00
其他资产			0.00
资产合计		3,217,385,603.81	1,366,408,757.58
负债与基金持有人权益			
应付证券款		19,865,368.69	50,004,653.78
应付赎回款		21,554,894.99	-
应付赎回费		100,895.83	-
应付管理人报酬		3,723,184.82	432,634.22
应付托管费		620,530.79	72,105.69
应付佣金	4(4)	3,679,250.70	366,230.33
应付利息			
应付收益			
未交扣金			
其他应付款	4(5)	1,000,060.75	250,000.00
卖出回购证券款		-	
短期借款			
预提费用	4(6)	200,000.00	-
其他负债			0.00
负债合计		50,744,186.57	51,125,624.02
持有人权益:			
实收基金	4(7)	1,470,284,026.01	1,315,856,024.96
未实现利得	4(8)	1,173,040,196.49	-322,729.40
未分配收益		523,317,194.74	-250,162.00
持有人权益合计		3,166,641,417.24	1,315,283,133.56
负债及持有人权益合计		3,217,385,603.81	1,366,408,757.58

经营业绩表(2006年1月1日--2006年12月31日)

金额单位:人民币元

项　目	附注	2006年1月1日-12月31日	2005年12月23日-12月31日
一、已实现基金收入		879,686,205.74	254,577.91
其中:股票差价收入	4(9)	799,548,276.64	-
债券差价收入	4(10)	-1,273,949.85	-
权证差价收入	4(11)	46,744,447.64	-
债券利息收入		348,811.41	-
存款利息收入		1,720,638.32	254,566.66
股利收入		26,496,411.42	-
买入返售证券收入			-
其他收入	4(12)	6,101,570.16	11.25
减:基金费用		40,685,729.92	504,739.91
其中:基金管理人报酬		34,483,457.57	432,634.22
基金托管费		5,747,242.93	72,105.69
卖出回购证券支出		117,158.00	-
利息支出		-	
其他费用	4(13)	337,871.42	-
其中:交易费用		1,700.04	-
信息披露费		220,000.00	-
审计费用		80,000.00	-
帐户维护费		18,000.00	-
银行费用		18,171.38	
二、已实现基金收益		839,000,475.82	-250,162.00
加:未实现利得		1,028,925,123.51	-322,729.40
三、基金经营业绩		1,867,925,599.33	-572,891.40

收益分配表(2006年1月1日至2006年12月31日期间)

金额单位:人民币元

	附注	2006年1月1日-12月31日	2005年12月23日-12月31日
本期基金净收益		839,000,475.82	-250,162.00
加:期初基金净收益		-250,162.00	
本期损益平准金		-17,553,249.30	-
可供分配基金净收益		821,197,064.52	-250,162.00
减:本期已分配基金净收益	4(14)	297,879,869.78	-
期末基金净收益		523,317,194.74	-250,162.00

基金净值变动表(2006年1月1日至2006年12月31日期间)

金额单位:人民币元

项　目	2006年1月1日-12月31日	2005年12月23日-12月31日
一、期初基金净值	1,315,283,133.56	1,315,856,024.96
二、本期经营活动		
基金净收益	839,000,475.82	-250,162.00
未实现利得	1,028,925,123.51	-322,729.40
经营活动产生的基金净值变动数	1,867,925,599.33	-572,891.40
三、本期基金份额交易		
基金申购款	5,188,355,334.98	-
基金赎回款	4,907,042,780.85	-
基金份额交易产生的基金净值变动数	281,312,554.13	-
四、本期向持有人分配收益		0.00
向持有人分配收益产生基金净值变动数	297,879,869.78	0.00
五、以前年度损益调整		0.00
因损益调整产生的净值变动数		
六、期末基金净值	3,166,641,417.24	1,315,283,133.56

(二)会计报表附注

1.主要会计政策和会计估计

(1).会计报表编制基础

本基金的会计报表乃按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》和《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》的规定而编制。

(2).会计年度

以1月1日起至12月31日止为一个会计年度。

(3).记账本位币

以人民币为记账本位币。

(4).记账基础和计价原则

以权责发生制为记账基础,除上市股票投资、债券投资与权证投资按市值计价外,其余均以历史成本为计价原则。

(5).基金资产的估值方法

a.已上市流通的有价证券的估值

上市流通的股票,以其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,以最近交易日的市价(收盘价)估值;

在证券交易所市场流通的债券,按如下估值方式处理:

1/ 实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,按最近交易日的收盘价估值。

2/ 未实行净价交易的债券按估值日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进行估值;估值日没有交易的,按最近交易日债券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进行估值。

b.处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

送股、转增股、配股和增发新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

首次公开发行的股票,按成本估值;

在银行间同业市场交易的债券和未上市的债券按成本估值。

c.配股权证,从配股除权日起到配股确认日止,如果收盘价高于配股价,按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价,则估值为零。

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的,基金管理人可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。

如有新增事项,按国家最新规定估值。

估值对象为基金所拥有的股票、债券和银行存款本息等资产。

(6).证券投资的成本计价方法

按加权移动平均法计算库存证券的成本。当日有买入和卖出时,先计算成本后计算买卖证券价差。

股票:

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。

a.上交所买入股票成本:由买入金额、买入印花税、买入过户费、买入经手费、买入证管费和买入佣金组成;

b.深交所买入股票成本:由买入金额、买入印花税、买入经手费和买入佣金组成;

债券:

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。债券投资成本按成交日应支付的全部价款入帐,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。

权证:

权证投资成本按成交日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确认日,按中国证券业协会公布的权证第一天价格确认为权证成本,并相应调整债券投资成本。

分离交易可转债:

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,后于权证确认日单独核算权证成本,并相应调整债券投资成本。

(7).待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用按直线法在受益期内平均摊销。

(8).收入的确认和计量

股票差价收入于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账;

证券交易所交易的债券差价收入于卖出成交日确认;银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入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;

权证差价收入于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账;

存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账;

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

股利收入于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账;

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;

其他收入于实际收到时确认收入。

(9).费用的确认和计量

基金管理费按照前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提;

基金托管费按照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。

(10).基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配比例为基金净收益的100%,本基金每年收益分配次数最少一次,最多为六次,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;

基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;

每一基金份额享有同等分配权;

法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

(11).基金申购、赎回的确认

在收到基金投资人申购或赎回申请之日后,于下一个工作日内对该交易的有效性进行确认。于确认日按照实收基金、未实现利得、未分配收益和损益平准金的余额占基金净值的比例,将确认有效的申购或赎回款项分割为三部分,分别确认为实收基金、未实现利得、损益平准金的增加或减少。

(12).实收基金

每份基金份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日列示。

(13).损益平准金

损益平准金为申购、赎回款中所含的按基金未分配净收益占基金净值比例计算的一部分金额,于计算基金申购、赎回确认日列示,并于期末全额转入未分配收益。

(14).预提费用的摊销方法和摊销期限。

本基金的预提费用包括审计费用和信息披露费用。预提费用按直线法每日预提。

(15).现金对价的会计处理

本基金报告期内收取的现金对价,于权益确认日冲减股票投资成本。

2.重大会计差错说明

本基金本报告期无重大会计差错

3.关联方关系及交易

(1)关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、代销机构
广发华福证券有限责任公司	基金管理人股东的子公司
广发北方证券经纪有限责任公司	基金管理人股东的子公司
广发期货经纪有限公司	基金管理人股东的子公司
广州科技风险投资有限公司	基金管理人股东
香江投资有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2)通过关联方席位进行的交易

a.　2006年度,本基金通过关联方席位进行股票、债券和权证交易的成交量:

关联方	交易量			占总交易量比例				
	股票	债券	权证	股票	债券	权证	佣金	占总佣金比例
广发证券股份有限公司	2,811,964,193.73	159,122,510.00	23,737,357.49	22.72%	63.63%	19.59%	2,280,034.08	22.79%
广发华福证券有限责任公司	2,464,658,276.98	88,526,025.60	17,095,941.10	19.91%	35.40%	14.11%	1,985,164.69	19.85%
合　计	5,276,622,470.71	247,648,535.60	40,833,298.59	42.63%	99.03%	33.70%	4,265,198.77	42.64%

b.　2005年12月23日(基金合同生效日)-12月31日,本基金通过关联方席位进行股票和权证交易的成交量:

关联方	交易量			占总交易量比例				
	股票	债券	权证	股票	债券	权证	佣金	占总佣金比例
广发证券股份有限公司	454,795,752.75	-	-	100%	-	-	366,230.33	100%

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(含债券交易)。

上述佣金按市场佣金率计算,佣金比率是公允的。

根据《证券研究服务协议》,本基金管理人从关联方获得证券研究综合服务。

(3)关联方报酬

a. 基金管理人报酬

基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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。本基金于本期应支付基金管理人管理费共计人民币34,483,457.57元,其中已支付基金管理人人民币30,760,272.75元,尚余人民币3,723,184.82元未支付。

b. 基金托管人报酬

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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。本基金于本期应支付基金托管人托管费共计人民币5,747,242.93元,其中已支付基金托管人人民币5,126,712.14元,尚余人民币620,530.79元未支付。

(4)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中国工商银行股份有限公司保管,并按银行间同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为192,338,944.51元。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为1,720,638.32元。2005年12月31日保管的银行存款余额为910,505,098.02元,2005年12月23日至2005年12月31日间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为254,566.66元。

(5)与关联方进行的银行间同业市场债券(含回购)交易

2006年度,本基金未与基金托管人中国工商银行股份有限公司通过银行间同业市场进行债券交易。

(6)关联方持有的基金份额

a.截至2006年12月31日,本基金关联方持有本基金情况如下:

关联方	2006-12-31		
	基金份额	占基金总份额比例	申购费(元)
广发基金管理有限公司	46,494,389.09	3.16%	1,000

b.截至2005年12月31日,本基金关联方持有本基金情况如下:

关联方	2005-12-31		
	基金份额	占基金总份额比例	申购费(元)
广发基金管理有限公司	29,999,000.00	2.28%	1,000

本年度本基金关联方持有的基金份额增加16,495,389.09份,申购费为1000元,2005年度的申购费为1,000元。

4.流通转让受到限制的基金资产

(1)截止2006年12月31日,流通转让受到限制的基金资产:

a.　截止2006年12月31日,因股权分置改革而暂时停牌,不能自由流通的股票如下:

股票代码	股票名称	数量	年末估值单价	年末估值总额	停牌日期	复牌日期	复牌当日单价
000549	S湘火炬	1,700,000	8.90	15,130,000.00	2006-12-19		
000895	S双汇	1,536,117	31.17	47,880,766.89	2006-6-1		

b.　截止2006年12月31日,因有重大信息披露而暂时停牌,不能自由流通的股票如下:

股票代码	股票名称	数量(股)	年末估值单价	年末估值总额	停牌日期	复牌日期	复牌当日单价
000046	泛海建设	1,137,846	18.70	21,277,720.20	2006-12-29	2007-1-4	20.22
600875	东方电机	2,377,082	22.19	64,418,922.20	2006-12-20	2007-2-5	29.81

c.　截止2006年12月31日,因非公开发行股份或网下配售限售条件,暂未能流通的股票如下:

股票代码	股票名称	数量(股)	年末成本单价(股)	年末成本总额(元)	年末估值单价(元)	年末估值总额(元)	流通日期
000839	中信国安	3,000,000	12.00	36,000,000.00	22.81	68,430,000.00	2007-8-23
600361	华联综超	1,560,372	12.92	20,160,000.00	23.09	36,028,989.48	2007-5-17
600456	宝钛股份	900,000	17.22	15,500,000.00	31.00	27,900,000.00	2007-9-13
600761	安徽合力	700,000	10.60	7,420,000.00	22.25	15,575,000.00	2007-7-7
601006	大秦铁路	159,390	4.95	788,980.50	8.10	1,291,059.00	2007-7-27
601988	中国银行	471,570	3.08	1,452,435.60	5.43	2,560,625.10	2007-1-5

(2)截至2005年12月31日,流通转让受到限制的基金资产

截至2005年12月31日,因股权分置改革而暂时停牌,不能自由流通的股票如下:

股票代码	股票名称	数量(股)	年末估值单价(元)	年末估值总额(元)	停牌日期	复牌日期	复牌当日单价(元)
000987	广州友谊	1,286,170	8.23	10,585,179.10	2005-12-30	2006-1-20	6.04

七、投资组合报告

(一)基金资产配置组合

	市值(元)	占总资产的比重
股票	2,872,931,135.25	89.29%
债券	0	0
权证	85,648,142.73	2.66%
银行存款和清算备付金	198,087,098.45	6.16%
其他资产	60,719,227.38	1.89%
合计	3,217,385,603.81	100.00%

(二)按行业分类的股票投资组合

行业	市值(元)	市值占净值比
A 农、林、牧、渔业	14,081,226.72	0.44%
B 采掘业	288,211,042.41	9.10%
C 制造业	1,214,494,567.58	38.35%
C0 食品、饮料	362,646,162.48	11.45%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	11,927,979.00	0.38%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	128,886,336.12	4.07%
C5 电子	42,853,788.03	1.35%
C6 金属、非金属	358,935,195.82	11.33%
C7 机械、设备、仪表	235,358,590.86	7.43%
C8 医药、生物制品	73,886,515.27	2.33%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
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	26,760,804.30	0.85%
G 信息技术业	167,907,514.40	5.30%
H 批发和零售贸易	445,535,048.00	14.07%
I 金融、保险业	365,420,311.89	11.54%
J 房地产业	323,729,391.95	10.22%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	5,253,000.00	0.17%
M 综合类	21,538,228.00	0.68%
合计	2,872,931,135.25	90.72%

(三)本基金持有前十名股票明细

科目代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占净值比
002024	苏宁电器	6,250,000	283,750,000.00	8.96%
600000	浦发银行	11,564,509	246,439,686.79	7.78%
600519	贵州茅台	2,507,130	220,201,227.90	6.95%
600048	保利地产	3,758,038	162,798,206.16	5.14%
600456	宝钛股份	4,100,000	127,100,000.00	4.01%
000792	盐湖钾肥	5,008,548	118,001,390.88	3.73%
600583	海油工程	3,312,450	114,842,641.50	3.63%
600028	中国石化	10,783,249	98,343,230.88	3.11%
600694	大商股份	3,260,000	95,811,400.00	3.03%
000839	中信国安	4,050,000	92,380,500.00	2.92%

提示:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.gffunds.com.cn)的本年度报告正文

(四)报告期内股票投资组合的重大变动

本报告期内累计买入金额超过净值2%的股票

股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占净值比(%)
600028	中国石化	285,088,949.41	21.68%
600000	浦发银行	201,158,868.70	15.29%
000792	盐湖钾肥	191,298,080.26	14.54%
600694	大商股份	176,193,630.85	13.40%
600900	长江电力	175,188,484.38	13.32%
600036	招商银行	144,547,006.92	10.99%
000060	中金岭南	136,931,679.43	10.41%
600048	保利地产	134,236,408.56	10.21%
600583	海油工程	130,948,860.14	9.96%
600887	伊利股份	115,754,031.87	8.80%
002024	苏宁电器	114,300,613.96	8.69%
000839	中信国安	113,786,257.96	8.65%
600497	驰宏锌锗	111,323,084.12	8.46%
600205	山东铝业	109,065,896.27	8.29%
600309	烟台万华	107,028,476.94	8.14%
600316	洪都航空	97,820,506.91	7.44%
000063	中兴通讯	96,573,913.87	7.34%
000157	中联重科	93,744,016.69	7.13%
600519	贵州茅台	92,145,831.16	7.01%
600383	金地集团	90,407,528.63	6.87%
600348	国阳新能	88,441,766.38	6.72%
600030	中信证券	83,969,019.00	6.38%
000402	金 融 街	78,195,802.98	5.95%
600489	中金黄金	77,842,355.98	5.92%
600016	民生银行	75,385,253.88	5.73%
600312	平高电气	74,954,105.84	5.70%
000069	华侨城 A	74,797,879.02	5.69%
600320	振华港机	70,164,789.72	5.33%
600015	华夏银行	66,858,906.82	5.08%
000002	万 科 A	63,604,324.91	4.84%
600456	宝钛股份	63,151,593.95	4.80%
000400	许继电气	60,561,173.01	4.60%
600037	歌华有线	59,692,799.46	4.54%
600549	厦门钨业	55,106,389.01	4.19%
600118	中国卫星	54,207,192.02	4.12%
600585	海螺水泥	53,556,811.33	4.07%
000031	中粮地产	53,523,520.66	4.07%
600875	东方电机	53,458,743.96	4.06%
000088	盐田港 A	52,975,197.36	4.03%
600183	生益科技	51,102,389.03	3.89%
000807	云铝股份	50,404,518.14	3.83%
600033	福建高速	50,166,751.31	3.81%
000898	鞍钢新轧	49,870,565.29	3.79%
600005	武钢股份	49,706,282.95	3.78%
000538	云南白药	47,887,479.99	3.64%
600420	现代制药	45,536,861.27	3.46%
600675	中华企业	45,071,246.01	3.43%
601006	大秦铁路	43,705,669.23	3.32%
600410	华胜天成	43,605,738.71	3.32%
600296	兰州铝业	42,932,486.58	3.26%
600050	中国联通	42,072,650.38	3.20%
600809	山西汾酒	40,644,843.76	3.09%
600143	金发科技	38,498,290.96	2.93%
000625	长安汽车	37,974,119.04	2.89%
600361	华联综超	37,202,196.51	2.83%
000012	南 玻 A	37,088,019.90	2.82%
000568	泸州老窖	33,967,400.54	2.58%
002025	航天电器	33,881,772.51	2.58%
600432	吉恩镍业	33,859,696.44	2.57%
600472	包头铝业	33,285,426.62	2.53%
600009	上海机场	33,178,722.80	2.52%
600680	山推股份	33,060,616.09	2.51%
600428	中远航运	32,095,735.08	2.44%
600867	通化东宝	29