

广发策略优选混合型证券投资基金 2007年半年度报告摘要

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...

资产负债表
单位:人民币元
2007年6月30日
资产: 货币资金 264,350,893.68
负债合计 218,191.88

经营业绩表
(2007年1月1日至2007年6月30日期间)
单位:人民币元

经营业绩表续
(2007年1月1日至2007年6月30日期间)
单位:人民币元
项目: 一、已实现基金收入 7,116,291,543.05
其中:股票差价收入 7,042,426,184.13

收益分配表
(2007年1月1日至2007年6月30日期间)
单位:人民币元

收益分配表续
(2007年1月1日至2007年6月30日期间)
单位:人民币元
项目: 一、本期基金净收益 6,991,293,819.47
加:期初基金净收益 751,628,480.33

基金净值变动表
(2007年1月1日至2007年6月30日期间)
单位:人民币元

基金净值变动表续
(2007年1月1日至2007年6月30日期间)
单位:人民币元
项目: 一、期初基金净值 19,300,418,663.45
二、本期经营活动 6,991,293,819.47

会计报表附注
(一)基金概况
1.基金名称
广发策略优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)

2.基金管理人
广发基金管理有限公司
3.基金托管人
中国工商银行股份有限公司

(二)基金投资目标
本基金在保持资产流动性、安全性和稳定性的基础上,追求基金资产的长期增值...

(三)基金投资策略
本基金采用自上而下的投资策略,在宏观、中观和微观三个层面上进行资产配置...

(四)基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率\*65%+中债综合指数收益率\*35%

(五)基金风险收益特征
本基金属于中高风险收益的证券投资基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金...

(六)基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(七)基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(八)基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(九)基金信息披露
本基金管理人应当按照法律法规和中国证监会的有关规定,及时披露基金信息...

(十)基金合同变更、终止和基金财产的清算
1.基金合同的变更
2.基金合同的终止

(十一)基金合同解除及争议解决
1.基金合同解除
2.争议解决

(十二)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(十三)基金合同附件
1.基金合同
2.托管协议

(十四)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(十五)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(十六)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(十七)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(十八)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(十九)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(二十)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(二十一)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(二十二)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(二十三)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(二十四)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(二十五)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(二十六)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(二十七)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(二十八)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(二十九)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(三十)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(三十一)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(三十二)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(三十三)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(三十四)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(三十五)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(三十六)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(三十七)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(三十八)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(三十九)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(四十)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(四十一)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(四十二)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(四十三)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

(四十四)基金合同其他事项
1.基金合同当事人
2.基金合同的效力

红利按红利发放日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,本基金赎回的收益分配方式...

(1) 基金申购、赎回的确认
收到投资者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...

(2) 赎回费
赎回费按赎回金额的一定比例收取,费率随持有时间的增加而递减...

(3) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(4) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(5) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(6) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(7) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(8) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(9) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(10) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(11) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(12) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(13) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(14) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(15) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(16) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(17) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(18) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(19) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(20) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(21) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(22) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(23) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(24) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(25) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(26) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(27) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(28) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(29) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(30) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(31) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(32) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(33) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(34) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(35) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(36) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(37) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(38) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(39) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(40) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(41) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(42) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(43) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(44) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(45) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(46) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(47) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(48) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(49) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(50) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(51) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(52) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(53) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(54) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(55) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(56) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(57) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

2.首次公开发行的股票,按成本估值。
上市市场待估股票,按公允价值估值...

(58) 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

(59) 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额...

(60) 基金资产估值
本基金采用公允价值进行估值,估值方法如下:
1.上市流通的有价证券,以其在估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值...

本报告期末累计卖出金额的前20名股票:
股票代码 股票名称 累计卖出金额 占净值比例%

本报告期末累计买入金额的前20名股票:
股票代码 股票名称 累计买入金额 占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%

本报告期末持有基金份额的前10名持有人续:
持有人名称 持有基金份额 持有份额占净值比例%