

广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）

半年度报告

（2006 年上半年）

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

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。本半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——上海浦东发展银行股份有限公司根据《广发小盘成长股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)规定,于 2006 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中的财务会计报告未经审计。

目 录

重要提示.....	2
一、基金简介.....	4
二、主要财务指标和基金净值表现.....	5
三、管理人报告.....	6
四、托管人报告.....	7
五、财务会计报告.....	9
六、投资组合报告.....	21
七、基金份额持有人户数、持有人结构.....	26
八、基金份额变动情况.....	27
九、重大事件揭示.....	27
十、备查文件目录.....	29

一、基金简介

(一)基金产品概况

基金名称：广发小盘成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)

基金简称：广发小盘

交易代码：162703

基金运作方式：上市契约型开放式

基金合同生效日：2005 年 2 月 2 日

基金份额上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

上市日期：2005 年 4 月 29 日

报告期末基金份额：916,620,218.69 份

投资目标：依托中国良好的宏观经济发展形势和资本市场的高速成长，通过投资于具有高成长性的小市值公司股票，以寻求资本的长期增值。

投资策略：

1、资产配置区间：股票资产配置比例为 60%-95%，债券资产配置比例为 0-15%，现金大于等于 5%。

2、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

3、股票投资管理的方法与标准

本基金在投资策略上采取小市值成长导向型，主要投资于基本面良好，具有高成长性的小市值公司股票。

4、债券投资策略

债券投资策略包括：利率预测、收益率曲线模拟、资产配置和债券分析。

业绩比较基准：天相小市值指数。

风险收益特征：较高风险，较高收益。

(二)基金管理人

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：广州市体育西路 57 号广东红盾大厦 14、15 楼

邮政编码：510620

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：020-85586130

电子邮箱：lhy@gffunds.com.cn

（三）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：陈耀先

电话：(0755) 82084015

传真：(0755) 82084010

联系人：朱立元

（四）基金托管人

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

邮政编码：200120

法定代表人：金运

信息披露负责人：张轶美

联系电话：021-61618888

传真：021-68881836

电子邮箱：zhangym2@spdb.com.cn

（五）本基金选定的信息披露报纸：中国证券报、上海证券报

投资者可以登陆本基金管理人互联网网址：<http://www.gffunds.com.cn> 查阅本基金半年度报告正文，也可以到本基金管理人和托管人的办公地点查阅本基金半年度报告。

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—6 月 30 日
基金本期净收益	327,579,307.92
基金份额本期净收益	0.4328
期末可供分配基金收益	246,113,787.20
期末可供分配基金份额收益	0.2685
期末基金资产净值	1,691,718,422.91
期末基金份额净值	1.8456
基金加权平均净值收益率	30.50%
本期基金份额净值增长率	90.93%
基金份额累计净值增长率	100.14%

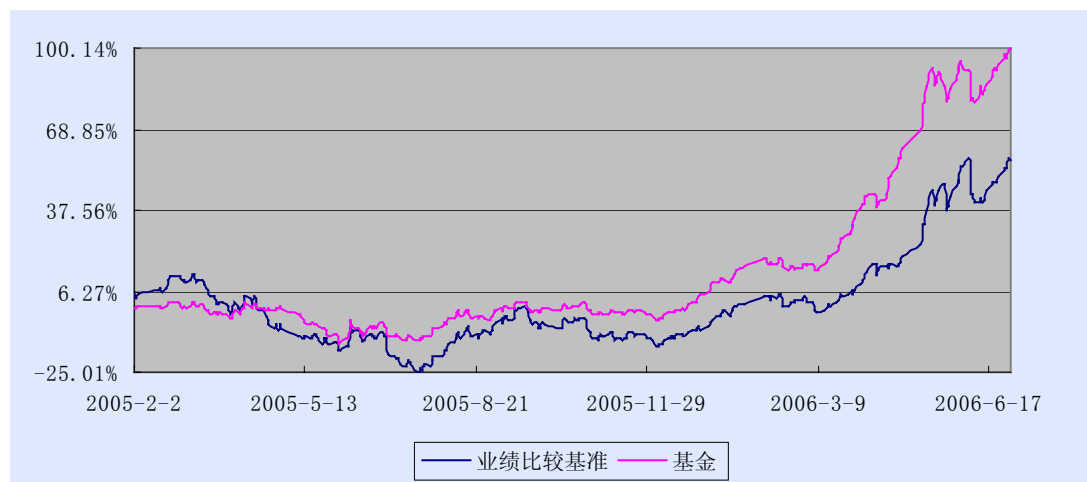
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（二）基金净值表现

1. 本基金本报告期单位基金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 1 个月	4.27%	0.0159	5.76%	0.0226	-1.49%	-0.0067
过去 3 个月	49.05%	0.0184	47.57%	0.0221	1.48%	-0.0037
过去 6 个月	90.93%	0.0152	71.70%	0.0178	19.23%	-0.0026
过去 1 年	120.97%	0.0127	82.87%	0.0166	38.10%	-0.0039
自基金合同生效以来	100.14%	0.0129	57.10%	0.0173	43.04%	-0.0044

2. 本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图



注：业绩比较基准：天相小市值指数

三、管理人报告

（一）基金管理人概况

本基金管理人由广发证券股份有限公司、广州科技风险投资有限公司、烽火通信科

技股份有限公司、香江投资有限公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准于 2003 年 8 月 5 日成立，目前实收资本为 1.2 亿元人民币。

本基金管理人在董事会下设合规审核委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 12 个部门：投资管理部、研究发展部、市场拓展部、机构理财部、监察稽核部、风险控制部、综合管理部、财务部、人力资源部、信息技术部、基金运营部、中央交易室。此外，还设立了北京分公司、广州分公司和上海分公司。

截止到 2006 年 6 月 30 日，本基金管理人管理六只开放式基金——广发聚富证券投资基金、广发稳健增长证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金，管理资产规模为 324.6 亿元。

（二）基金经理小组成员情况：

陈仕德：男，投资管理部副总经理，经济学硕士，13 年证券从业经历，曾任广发证券公司广发基金资产管理部副总经理兼广东广发基金的基金经理、广发证券股份有限公司广国投基金部托管组负责人和广东华信体育西证券营业部托管组负责人。

（三）基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发小盘成长股票型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。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

（四）基金运作及市场情况回顾与展望

1. 市场回顾

今年上半年的 A 股市场出现了自本世纪以来久违的强劲上涨，上证综指在本报告期上涨了 44.02%。在全社会资本流动性过剩及产业领域投资的不确定性越来越大的情况下，资金往上处于洼地的资本市场流动再正常不过，加之市场中相当多的上市公司的估值偏低，或者其重估价值远远高于其帐面或市场价值，从而对产业资本产生了很强的吸引力。在此背景下，投资者的信心越来越强，流入市场的资金增速越来越快，估值吸引加资金推动是本轮行情的主要特征。从行业及板块来看，市场中涨幅相对较大的有券商板块、有色金属、食品饮料、商业零售、装备制造和国防军工等成长性高或预期未来成长性高的行业和板块。

2. 基金运作回顾

广发小盘基金本报告期内投资管理取得了比较好的业绩，基金净值增长率为 90.93%，超越同期上证综指涨幅和深证综指涨幅。更远远超越同期的比较基准。报告期内，我们坚持了一贯的投资思路：第一、寻找有成长为行业小巨人潜质的中小市值公司，长期持有；第二、寻找价值被低估且所处行业进入复苏期的周期性股票，谋取阶段性收益。在投资策略上，我们采取了战略进攻，均衡配置的策略。在投资目标的甄别上，我们采取了自下而上的策略。具体到行业资产配置上，我们配置的重点主要有有色金属、食品饮料、中医药及医药流通、商业零售、装备制造和国防军工等具自主创新技术优势的企业。

3. 展望

对于未来的市场趋势，我们认为，随着全流通时代的到来及管理层激励的实施，上市公司管理层既有压力也有动力致力于搞好经营管理，上市公司治理结构的改善，以及 IPO 及再融资的重新启动，A 股市场投资价值的黄金时期即将到来，投资人也将更有信心进入市场，股市的结构性牛市仍会持续。在未来的市场环境下，我们将牢牢抓住“内需驱动，持续成长”这条投资主线，并顺应市场，适时进行结构和比例的调整与转换，相信一定能为持有人谋取到不错的回报。

四、托管人报告

上海浦东发展银行股份有限公司依据《广发小盘成长股票型证券投资基金基金合同》与《广发小盘成长股票型证券投资基金托管协议》，托管广发小盘成长股票型证券投资基金。

2006 年上半年，在对广发小盘成长股票型证券投资基金的托管过程中，上海浦东发展银行股份有限公司严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同、托管协议的规定，安全保管了基金的全部资产，对广发小盘成长股票型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，我行遵循笃守诚信、勤勉尽责、严格自律、追求卓越的工作精神，履行了托管人的义务，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

2006 年上半年，上海浦东发展银行股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同、托管协议的规定，对广发小盘成长股票型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值、基金份额申购赎回价格、基金费用开支等进行了认真的复核，未发现基金管理人在投资运作中有损害基金份额持有人利益的行为。

经上海浦东发展银行股份有限公司资产托管部复核，由广发基金管理有限公司编制的

本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

五、财务会计报告

(一) 基金会计报表

资产负债表

(2006 年 6 月 30 日)

金额单位：人民币元

资 产	附注	2005-12-31	2006-6-30
资产：			
银行存款		102,189,874.57	99,465,972.92
清算备付金		485,537.20	6,094,685.95
交易保证金		2,330,000.00	2,580,000.00
应收证券款		27,349,741.77	0.00
应收股利		0	206,516.39
应收利息	4(1)	45,169.12	44,999.95
应收申购款		9,852.22	7,674,177.89
其他应收款		0	4,240,000.00
股票投资市值		733,005,137.31	1,592,840,488.69
其中：股票投资成本		664,470,492.22	1,169,870,156.32
债券投资市值		0	
其中：债券投资成本		0	
权证投资		0	
其中：权证投资成本		0	
买入返售证券		0	
待摊费用		0	
其他资产			
资产合计		865,415,312.19	1,713,146,841.79
负债与基金持有人权益			
应付证券款		0	4,672,708.79
应付赎回款		71,422,388.45	11,134,814.16
应付赎回费		257,709.21	41,965.36
应付管理人报酬		1,045,508.54	1,989,114.96
应付托管费		174,251.41	331,519.19
应付佣金	4(5)	461,284.47	1,849,611.91
应付利息			
应付收益			
未交扣金			

其他应付款	4(6)	1,000,000.00	1,250,000.00
卖出回购证券款			
短期借款			
预提费用	4(7)	150,000.00	158,684.51
其他负债		0	0.00
负债合计		74,511,142.08	21,428,418.88
持有人权益：			
实收基金	4(2)	754,511,990.09	916,620,218.69
未实现利得	4(3)	59,401,471.39	528,984,417.02
未分配收益		-23,009,291.37	246,113,787.20
持有人权益合计		790,904,170.11	1,691,718,422.91
负债及持有人权益合计		865,415,312.19	1,713,146,841.79

经营业绩表

(2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日期间)

金额单位：人民币元

项目	附注	2005-2-2 至 2005-6-30	2006-1-1 至 2006-6-30
一、收入		-17,560,412.74	337,064,576.60
1、股票差价收入	4(8)	-31,104,516.80	315,915,997.16
2、债券差价收入	4(9)	0.00	-113,403.30
3、权证差价收入	4(10)		3,545,792.44
4、债券利息收入		0.00	164,050.71
5、存款利息收入		2,610,276.17	743,412.19
6、股利收入		10,692,387.89	14,769,532.60
7、买入返售证券收入		0.00	0.00
8、其他收入	4(11)	241,440.00	2,039,194.80
二、费用		8,399,840.42	9,485,268.68
1、基金管理人报酬		7,042,287.07	7,938,912.25
2、基金托管费		1,173,714.53	1,323,152.08
3、卖出回购证券支出		0.00	45,568.00
4、利息支出		0.00	
5、其他费用	4(12)	183,838.82	177,636.35
其中：			
上市年费		12,486.52	
信息披露费		143,183.04	119,012.93
审计费用		22,372.35	39,671.58
其他		5,796.91	18,951.84
三、基金净收益		-25,960,253.16	327,579,307.92
加：未实现利得		-87,024,151.98	354,435,687.28
四、基金经营业绩		-112,984,405.14	682,014,995.20

收益分配表

(2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日期间)

金额单位：人民币元

项目	附注	2005-2-2 至 2005-6-30	2006-1-1 至 2006-6-30
本期基金净收益		-25,960,253.16	327,579,307.92
加：期初基金净收益		0.00	-23,009,291.37
加：本期损益平准金		1520325.03	16,731,392.87
可供分配基金净收益		-24,439,928.13	321,301,409.42
加：以前年度损益调整		0.00	
减：本期已分配基金净收益	4(13)	0.00	75,187,622.22
期末基金净收益		-24,439,928.13	246,113,787.2

基金净值变动表

(2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日期间)

金额单位：人民币元

项目	2005-2-2 至 2005-6-30	2006-1-1 至 2006-6-30
一、期初基金净值	1,175,436,171.10	790,904,170.11
二、本期经营活动		
基金净收益	-25,960,253.16	327,579,307.92
未实现利得	-87,024,151.98	354,435,687.28
经营活动产生的净值变动数	-112,984,405.14	682,014,995.20
三、本期基金单位交易		
基金申购款	126,737,263.55	1,925,343,206.61
基金赎回款	-185,735,000.00	-1,631,356,326.79
基金单位交易产生的净值变动数	-58,997,736.45	293,986,879.82
四、本期向持有人分配收益		
向基金持有人分配收益产生的净值变动数	0	-75,187,622.22
五、以前年度损益调整		
因损益调整产生的净值变动数	0	
六、期末基金净值	1,003,454,029.51	1,691,718,422.91

(二) 会计报表附注

1.基金简介

广发小盘成长股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经证监基金字[2004]195号

文《关于同意广发小盘成长股票型证券投资基金募集的批复》批准,由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发小盘成长股票型证券投资基金基金合同》发起,于2005年2月2日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行。本基金已向中国证券监督管理委员会备案,并获中国证监会基金部函[2005]27号《关于广发小盘成长股票型证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为2004年12月20日至2005年1月25日,本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次募集资金为1,175,436,171.10元,有效认购户数为12,393户。其中,认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币247,780.56元,利息结转的基金份额247,780.56份,按照《广发小盘成长股票型证券投资基金基金合同》的有关约定计入投资者基金账户。本基金募集资金经深圳天健信德会计师事务所验资。基金合同于2005年2月2日生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,175,436,171.10份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发小盘成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证券监督管理委员会批准的允许基金投资的其他金融工具。

1. 主要会计政策

(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3号《半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

本基金的会计年度为公历1月1日至12月31日止。本报告会计报表实际编制期间为2006年1月1日至6月30日止。

(3) 记帐本位币

本基金以人民币为记帐本位币。

(4) 记帐基础和计价原则

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

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。

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；估值日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）估值。

首次公开发行的股票，按成本估值。

配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按市价高于配股价的差额估值；如果市价低于配股价，估值为零。

权证，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日未上市的，按 B-S 模型估值。

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有价证券。

(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。

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；

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。

权证投资成本按成交日支付的全部价款入账。

(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). 收入确认

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

基金收益分配比例为基金净收益的 100%。

场外投资者可以选择现金分红或红利再投资；场内投资者只能选择现金分红；本基金分红的默认方式为现金分红。

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，最多不超过六次，但若合同生效不满 3 个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成。

基金当年收益先弥补基金上一年度亏损后，方可进行当年收益分配。

如果基金投资当期出现亏损，则基金当年不进行收益分配。

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

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。

3. 主要税项

1. 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]11 号文《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》，自 2005 年 1 月 24 日起，基金管理人运用基金买卖股票按照 1%的税率征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围，不征收营业税；根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入，由上市公司及债券发行企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。根据财政部、国家税务总局[2005]102 号文《关于股息红利有关个人所得税有关政策的通知》与财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》，对本基金自 2005 年 6 月 13 日起从上市公司分配取得的股息红利所得，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额。

4. 主要报表项目说明

金额单位：人民币元

(1) 应收利息

应收利息明细项目列示如下：

项 目	2006 年 6 月 30 日
应收银行存款利息	41,992.96
应收清算备付金利息	2,468.34
应收权证保证金利息	538.65
合 计	44,999.95

(2) 实收基金

项 目	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
期初数	754,511,990.09
加：本期因申购的增加数	1,364,432,119.97
减：本期因赎回的减少数	1,202,323,891.37
期末数	916,620,218.69

(3) 未实现利得

项 目	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
期初数	59,401,471.39
加：投资估值增值	354,435,687.28
本期申购的未实现利得平准金	461,502,029.91
减：本期赎回的未实现利得平准金	346,354,771.56
期末数	528,984,417.02

(4) 投资估值增值

项 目	2006 年 6 月 30 日
股票投资估值增值	422,970,332.37
合 计	422,970,332.37

(5) 应付佣金

券商名称	2006-6-30
广发证券股份有限公司	864,470.70
金元证券有限责任公司	185,674.27
国信证券有限责任公司	95,169.98
国金证券有限公司	59,678.60
渤海证券有限责任公司	492,342.90

申银万国证券股份有限公司	152,275.46
合 计	1,849,611.91

(6) 其他应付款

项目	2006-6-30
应付广发证券股份有限公司垫付保证金	250,000.00
应付天和证券经纪有限公司垫付保证金	250,000.00
应付渤海证券有限责任公司垫付保证金	250,000.00
应付国金证券有限公司垫付保证金	250,000.00
应付中银国际证券公司垫付保证金	250,000.00
合 计	1,250,000.00

(7) 预提费用

项目	2006-6-30
审计费用	39,671.58
信息披露费	119,012.93
合 计	158,684.51

(8) 股票差价收入

项 目	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,772,479,520.71
减：卖出股票成本总额	1,455,082,869.12
应付佣金	1,480,654.43
股票差价收入	315,915,997.16

(9) 债券差价收入

项目	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
卖出债券成交总金额	39,121,834.42
减：卖出债券总成本	36,864,872.34
应收利息	2,370,365.38
债券差价收入	-113,403.30

(10). 权证差价收入

项 目	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	3,545,792.44
减：卖出权证成本总额	
权证差价收入	3,545,792.44

(11). 其他收入

项 目	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,039,194.80
合 计	2,039,194.80

(12). 其他费用

项 目	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
信息披露费	119,012.93
审计费用	39,671.58
银行费用	9409.31
回购手续费	542.53
帐户维护费	9,000.00
合 计	177,636.35

(13) 本期已分配基金净收益

本基金本期共进行了三次收益分配，收益分配金额共计 75,187,622.22 元，明细列示如下：

红利发放日期	金额
2006 年 2 月 16 日	29,984,292.22
2006 年 3 月 6 日	19,882,004.21
2006 年 5 月 11 日	25,321,325.79
合 计	75,187,622.22

(14) 股权分置改革现金对价对股票投资成本的影响

本基金本期由于股权分置改革获得现金对价，导致本报告期股票投资成本减少 4,325,044.55 元。

5.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
上海浦东发展银行股份有限公司	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

2006 年 1 月 1 日-6 月 30 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	1,684,957,587.59	39,123,790.6	1,460,280.69	45.31%	50.03%	41.18%	1,375,128.71	45.84%

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：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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 7,938,912.25 元，其中已支付

基金管理人人民币 5,949,797.29 元，尚余人民币 1,989,114.96 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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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 1,323,152.08 元，其中已支付基金托管人人民币 991,632.89 元，尚余人民币 331,519.19 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上海浦东发展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 6 月 30 日保管的银行存款余额为 99,465,972.92 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 707,197.09 元。

(5) 关联方持有的基金份额

截至 2006 年 6 月 30 日止，本基金关联方持有本基金的份额及比例如下：

关联方名称	期末持有基金份额	占基金总份额的比例
广发证券股份有限公司	12,364,760.40	1.35%
广发华福证券有限责任公司	17,369,236.07	1.89%

6. 流通转让受到限制的基金资产

(1) 网下配售，流通受限的股票

股票代码	股票名称	申购方式	申购确认日	数量	成本	市值	上市流通日	估值方法	转让受限原因
600361	G综超	网下配售	2006-5-18	1,300,310	16,800,000	23,483,598.60	2007-5-17	收盘价	锁定期

(2) 股权分置改革，流通受限的股票

股票代码	股票名称	数量	单价 (元)	估值总额	停牌日期	复牌日期	复牌开盘 单价
000715	中兴商业	2,000,000	13.79	27,580,000.00	2006-6-7	<u>2006-8-18</u>	<u>8.51</u>
600033	G闽高速	2,929,981	8.12	23,791,445.72	2006-6-29	<u>2006-7-14</u>	<u>6.15</u>
600383	金地集团	3,402,700	8.57	29,161,139.00	2006-6-13	<u>2006-7-11</u>	<u>9.43</u>
600786	东方锅炉	1,900,000	24.98	47,462,000	2006-6-17	<u>2006-7-4</u>	<u>27.00</u>
600859	王府井	4,749,063	12.95	61,500,365.85	2006-6-29	<u>2006-7-14</u>	<u>13.30</u>

六、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	1,592,840,488.69	92.98%
债券	0	0
权证	0	0
银行存款和清算备付金	105,560,658.87	6.16%
其他资产	14,745,694.23	0.86%
合计	1,713,146,841.79	100.00%

(二)按行业分类的股票投资组合

行业	市值	净值比
A 农、林、牧、渔业	33,833,801.00	2.00%
B 采掘业	143,499,895.51	8.48%
C 制造业	1,015,564,973.97	60.03%
C0 食品、饮料	187,393,652.50	11.08%
C1 纺织、服装、皮毛	31,481,685.00	1.86%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5 电子	52,043,951.72	3.08%
C6 金属、非金属	196,181,290.10	11.60%

C7 机械、设备、仪表	363,483,745.11	21.49%
C8 医药、生物制品	157,485,799.62	9.31%
C99 其他制造业	27,494,849.92	1.63%
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	23,791,445.72	1.41%
G 信息技术业	37,682,000.00	2.23%
H 批发和零售贸易	254,084,841.45	15.02%
I 金融、保险业	0.00	0.00%
J 房地产业	78,261,119.04	4.63%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	6,122,412.00	0.36%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	1,592,840,488.69	94.16%

(三) 本基金持有的所有股票明细

证券代码	证券名称	库存数量	证券市值	市值占净值 %
600809	G 汾酒	4,650,690	80,782,485.30	4.78%
600316	洪都航空	2,298,212	79,816,902.76	4.72%
600456	G 宝钛	1,445,761	68,948,342.09	4.08%
600535	G 天士力	4,104,823	68,919,978.17	4.07%
600497	G 驰宏	1,829,400	63,846,060.00	3.77%
600859	王府井	4,749,063	61,500,365.85	3.64%
000807	G 云铝	9,451,797	57,466,925.76	3.40%
000869	G 张裕	1,488,840	55,995,272.40	3.31%
600361	G 综超	3,053,110	55,139,116.60	3.26%
600786	东方锅炉	1,900,000	47,462,000.00	2.81%
600150	G 重机	2,092,200	46,174,854.00	2.73%
600761	G 合力	3,103,851	45,688,686.72	2.70%
600320	G 振华	2,310,029	45,599,972.46	2.70%
600489	G 中黄金	2,376,027	44,788,108.95	2.65%
600616	G 食品	2,609,926	41,028,036.72	2.43%
600472	G 包铝	4,493,656	37,566,964.16	2.22%
600312	G 平高	3,070,524	36,846,288.00	2.18%
600183	G 生益	3,286,698	36,022,210.08	2.13%
600547	G 鲁黄金	1,207,262	34,865,726.56	2.06%
600360	G 华微	2,936,074	34,586,951.72	2.04%
600549	G 厦钨	2,103,139	32,199,058.09	1.90%
600677	G 航通	3,497,965	31,481,685.00	1.86%
600085	G 同仁堂	1,900,000	31,103,000.00	1.84%
600161	G 天坛	2,081,388	30,284,195.40	1.79%
600383	金地集团	3,402,700	29,161,139.00	1.72%
000715	中兴商业	2,000,000	27,580,000.00	1.63%

000028	G 一致	4,200,715	27,178,626.05	1.61%
600511	国药股份	1,769,151	25,617,306.48	1.51%
600675	G 中企	5,000,000	24,550,000.00	1.45%
600533	G 栖霞	2,199,819	24,549,980.04	1.45%
600089	G 特变	1,878,381	24,212,331.09	1.43%
600694	大商股份	578,108	23,904,765.80	1.41%
600033	G 闽高速	2,929,981	23,791,445.72	1.41%
600438	G 通威	2,532,030	22,889,551.20	1.35%
002027	七喜股份	2,975,000	21,182,000.00	1.25%
600597	光明乳业	2,486,289	19,765,997.55	1.17%
600525	G 长园	1,097,152	19,704,849.92	1.16%
002024	苏宁电器	377,250	19,315,200.00	1.14%
600893	华润生化	2,599,985	17,809,897.25	1.05%
000733	G 振华科	2,300,000	17,457,000.00	1.03%
600118	G 卫星	1,000,000	16,500,000.00	0.98%
600197	G 伊力特	2,000,000	13,040,000.00	0.77%
002041	登海种业	585,254	10,944,249.80	0.65%
600206	G 有研	1,000,000	7,790,000.00	0.46%
600880	G 博瑞	409,800	6,122,412.00	0.36%
600416	G 湘电	150,000	1,660,500.00	0.10%

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动

累计买入金额超过基金资产净值 2% 的股票明细			
股票代码	股票名称	累计买入金额	占净值比 (%)
600786	东方锅炉	54,748,157.71	6.92%
600859	王府井	54,154,540.70	6.85%
600535	G 天士力	52,994,902.97	6.70%
000807	G 云铝	48,604,949.09	6.15%
600547	G 鲁黄金	42,363,452.43	5.36%
600015	G 华夏	40,151,538.10	5.08%
600472	G 包铝	40,019,152.74	5.06%
600320	G 振华	39,976,652.68	5.05%
600549	G 厦钨	39,405,382.03	4.98%
600519	G 茅台	35,658,505.76	4.51%
000063	G 中兴	35,640,328.49	4.51%
600331	G 宏达	34,724,793.22	4.39%
600118	G 卫星	34,303,170.17	4.34%
600675	G 中企	34,134,663.91	4.32%
000012	G 南玻	33,975,346.96	4.30%
600900	G 长电	32,425,497.17	4.10%
000625	G 长安	30,716,365.95	3.88%
600085	G 同仁堂	30,713,631.84	3.88%

600497	G 驰宏	30,687,859.71	3.88%
600361	G 综超	30,612,989.74	3.87%
600677	G 航通	30,570,556.61	3.87%
000060	G 中金	30,415,541.69	3.85%
600489	G 中黄金	29,902,499.11	3.78%
600161	G 天坛	29,285,088.22	3.70%
600761	G 合力	29,055,737.03	3.67%
600150	G 重机	28,685,106.74	3.63%
000680	G 山推	28,320,584.95	3.58%
600183	G 生益	27,861,599.38	3.52%
000050	G 深天马	27,598,256.28	3.49%
600316	洪都航空	27,071,321.86	3.42%
600360	G 华微	26,986,788.00	3.41%
600022	G 济钢	25,100,935.70	3.17%
600432	G 吉恩	24,901,777.84	3.15%
600533	G 栖霞	24,809,586.91	3.14%
600312	G 平高	23,975,648.79	3.03%
002027	七喜控股	23,907,071.20	3.02%
600033	G 闽高速	23,295,067.78	2.95%
000028	G 一致	23,069,912.26	2.92%
600438	G 通威	22,882,115.13	2.89%
600089	G 特变	22,831,860.67	2.89%
600740	G 山焦	20,774,368.58	2.63%
600893	华润生化	20,342,377.31	2.57%
600694	大商股份	20,309,504.56	2.57%
600456	G 宝钛	19,842,407.97	2.51%
600525	G 长园	18,617,388.63	2.35%
000831	G 关铝	18,548,309.05	2.35%
600309	G 万华	18,418,884.55	2.33%
000629	G 新钢钒	18,386,030.60	2.32%
000528	G 柳工	18,049,964.47	2.28%
600511	国药股份	16,985,940.68	2.15%
600616	G 食品	16,942,498.61	2.14%
600597	光明乳业	16,276,725.41	2.06%
000002	G 万科 A	16,177,222.12	2.05%
600282	南钢股份	15,925,773.06	2.01%
600875	G 东电	15,900,375.31	2.01%
累计卖出金额超过基金资产净值 2%的股票明细			
股票代码	股票名称	累计卖出金额	占净值比 (%)
000911	G 南糖	78,072,118.17	9.87%
600549	G 厦钨	74,316,045.22	9.40%
000063	G 中兴	65,743,628.40	8.31%
000012	G 南玻	58,549,888.39	7.40%
600269	G 赣粤	50,858,564.73	6.43%
600331	G 宏达	47,159,089.91	5.96%

000970	G 三环	45,325,434.83	5.73%
000625	G 长安	41,867,347.49	5.29%
600015	G 华夏	40,716,188.09	5.15%
000060	G 中金	39,809,271.02	5.03%
600519	G 茅台	39,089,285.81	4.94%
600317	G 营口港	36,427,928.44	4.61%
000528	G 柳工	35,206,327.59	4.45%
000680	G 山推	34,367,244.73	4.35%
600309	G 万华	33,769,188.26	4.27%
600432	G 吉恩	33,463,098.75	4.23%
000024	G 招商局	33,266,019.72	4.21%
600628	G 新世界	32,815,111.95	4.15%
600900	G 长电	30,368,381.95	3.84%
000050	G 深天马	30,122,665.49	3.81%
600436	G 片仔癀	29,089,384.03	3.68%
000619	G 海型材	26,798,434.86	3.39%
600456	G 宝钛	26,751,146.83	3.38%
600022	G 济钢	25,420,313.69	3.21%
600472	G 包铝	25,408,947.80	3.21%
600271	G 航信	24,546,628.82	3.10%
600535	G 天士力	24,251,251.59	3.07%
600059	G 龙山	22,941,058.31	2.90%
600418	G 江汽	22,540,867.94	2.85%
600740	G 山焦	21,276,897.75	2.69%
600875	G 东电	21,037,849.61	2.66%
600361	G 综超	20,843,104.47	2.64%
600585	G 海螺	19,275,167.65	2.44%
600729	G 重百	18,519,221.82	2.34%
000157	G 中联	18,289,041.24	2.31%
600118	G 卫星	17,913,979.02	2.26%
000629	G 新钢钒	17,595,744.53	2.22%
000831	G 关铝	17,305,239.60	2.19%
600497	G 驰宏	17,151,987.50	2.17%
000002	G 万科 A	16,827,866.15	2.13%
600316	洪都航空	16,580,082.83	2.10%
600832	G 明珠	16,449,066.83	2.08%
600114	G 东睦	16,234,134.47	2.05%
600616	G 食品	16,139,293.20	2.04%
600282	南钢股份	16,120,834.51	2.04%
000021	G 深科技	16,014,955.62	2.02%
000822	G 海化	15,935,145.63	2.01%
600420	G 现代	15,841,895.03	2.00%
报告期内买入股票总成本:		1,964,807,577.77	

报告期内卖出股票收入总额:	1,772,479,520.71
---------------	------------------

(五) 投资组合报告附注

1. 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的 10%。
2. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。
3. 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
4. 本基金本报告期其他资产的构成包括交易保证金 2,580,000.00 元,应收利息 44,999.95 元, 应收股利 206,516.39 元, 应收申购款 7,674,177.89 元, 其他应收款(应收新股申购款)4,240,000 元, 合计为 14,745,694.23 元。
5. 本基金本报告期末持有处于转换期的可转换债券。
6. 本基金本报告期末持有资产支持证券。
7. 本基金本报告期所获得的权证均为被动持有,系股权分置改革支付对价所获,本报告期内共获得长电 CWB1(580007)622500 份、茅台 JCP1(580990)491677 份,成本总额为 0 元。

七、基金份额持有人户数、持有人结构

(一) 基金份额持有人户数、持有人结构:

期末基金持有人户数(户)	7,125
期末平均每户持有基金份额	128,648.45
期末机构投资者持有份额	693,415,906.45
期末机构投资者份额占总份额比例	75.65%
期末个人投资者持有份额	223,204,312.24
期末个人投资者份额占总份额比例	24.35%

(二) 本基金场内前十名持有人情况:

序号	客户名称	持有份额	所占比例
----	------	------	------

1	国信证券有限责任公司	10,001,200.00	8.63%
2	联合证券有限责任公司	4,743,600.00	4.09%
3	王晓金	2,794,328.00	2.41%
4	关松娣	2,010,522.00	1.74%
5	付晓伟	1,500,180.00	1.29%
6	余建伟	1,200,288.00	1.04%
7	凌菲菲	1,000,220.00	0.86%
8	郭玉霞	1,000,000.00	0.86%
9	韩媛	888,300.00	0.77%
10	林钦雄	800,000.00	0.69%
合计		25,938,638.00	22.39%

八、基金份额变动情况

合同生效日基金总份额	1,175,436,171.10
期初余额	754,511,990.09
期内申购总份额	1,364,432,119.97
期内赎回总份额	1,202,323,891.37
期末余额	916,620,218.69

九、重大事件揭示

- 1、本报告期内未召开基金份额持有人大会；
- 2、本报告期内本基金托管人的资产托管部门未有重大人事变动；
- 3、在本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。
- 4、在本报告期内本基金的投资组合策略没有重大改变。
- 5、本基金管理人于 2006 年 2 月 10 日在《中国证券报》、《上海证券报》发布分红公

告，向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.40 元。权益登记日为 2006 年 2 月 14 日，场外除息日：2006 年 2 月 14 日，场内除息日：2006 年 2 月 15 日，红利分配日为 2006 年 2 月 16 日。

6、本基金管理人于 2006 年 2 月 25 日在《中国证券报》、《上海证券报》发布分红公告，向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.30 元。权益登记日为 2006 年 3 月 2 日，场外除息日：2006 年 3 月 2 日，场内除息日：2006 年 3 月 3 日，红利分配日为 2006 年 3 月 6 日。

7、本基金管理人于 2006 年 4 月 28 日在《中国证券报》、《上海证券报》发布分红公告，向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.30 元。权益登记日为 2006 年 5 月 9 日，场外除息日：2006 年 5 月 9 日，场内除息日：2006 年 5 月 10 日，红利分配日为 2006 年 5 月 11 日。

8、本基金管理人于 2006 年 4 月 7 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，从 4 月 7 日起暂停本基金单笔金额 100 万元以上（不含 100 万元）的申购和从我司管理的其他开放式基金单笔金额 100 万元以上（不含 100 万元）转入本基金的业务。本基金管理人于 2006 年 5 月 12 日刊登公告，于 2006 年 5 月 12 日起恢复本基金的正常申购及转入业务。

9、本基金管理人于 2006 年 4 月 12 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加广东发展银行股份有限公司为本基金的代理销售机构。

10、本基金管理人于 2006 年 4 月 25 日在《中国证券报》、《上海证券报》发布本基金场内交易价格异常波动的公告，对本基金于 2006 年 4 月 24 日场内交易价格达到涨幅限制进行说明，提醒广大投资者注意投资风险。

11、本基金管理人于 2006 年 6 月 8 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加招商银行股份有限公司为本基金的代理销售机构。

12、本基金管理人于 2006 年 6 月 19 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加湘财证券有限责任公司为本基金的代理销售机构。

13、本基金管理人于 2006 年 5 月 26 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，江涌先生辞去本基金基金经理职务。

14、报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

15、本基金的基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

16、本报告期内，基金租用证券公司专用席位的情况：

1) 各席位券商股票、国债及回购交易和佣金情况如下:

金额单位: 人民币元

(1) 股票交易及佣金支付情况:

席位名称	租用席位数量	股票交易金额	比例	佣金	比例
广发证券	2	1,684,957,587.59	45.31%	1,375,128.71	45.84%
金元证券	1	226,801,576.92	6.10%	185,674.27	6.19%
国信证券	1	348,602,328.16	9.37%	285,849.30	9.53%
国金证券	1	167,742,608.19	4.51%	131,260.46	4.38%
渤海证券	1	950,741,878.62	25.57%	743,968.43	24.80%
申银万国证券	1	257,871,064.04	6.93%	210,728.64	7.02%
长城证券	1	81,941,129.64	2.20%	67,190.46	2.24%
合计	8	3,718,658,173.16	100.00%	2,999,800.27	100.00%

(2) 债券及回购交易情况:

席位名称	席位租用数量	债券交易金额	比例	回购交易金额	比例
广发证券	2	39,123,790.60	50.03%		0%
金元证券	1	0		30,000,000.00	47.32%
国信证券	1			0	0%
国金证券	1	0		0.00	0.00
渤海证券	1				
申银万国证券	1	39,069,233.50	49.97%	33,400,000.00	52.68%
长城证券	1	0	0	0	0%
合计	8	78,193,024.10	100.00%	63,400,000.00	100.00%

2) 交易席位变更情况:

本报告期内, 本基金新增中银国际专用席位。

十、备查文件目录

(一) 备查文件目录:

- 1、中国证监会批准广发小盘成长股票型证券投资基金募集的文件;
- 2、《广发小盘成长股票型证券投资基金基金合同》;
- 3、《广发小盘成长股票型证券投资基金托管协议》;
- 4、《广发小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》;

- 5、《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》
- 6、广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 7、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、投资组合公告及其他临时公告。

(二)存放地点：广州市体育西路 57 号红盾大厦 14 楼、15 楼

(三) 查阅方式：

1. 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:00。
2. 网站查询：网址：<http://www.gffunds.com.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话：020-83936999 或 95105828，E-mail:services@gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二零零六年八月二十九日