

汉兴证券投资基金 2006年半年度报告摘要

重要提示

富国基金管理有限公司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。

基金托管人交通银行根据本基金合同规定，于2006年8月26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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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预示其未来表现。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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

一、基金简介

(一)基金简称:基金汉兴
交易代码:600015
运作方式:契约型封闭式
基金合同生效日:1999年12月30日

(二)投资目标:本基金为平衡型证券投资基金,兼顾确定收益和资本利得,即在投资于绩优上市公司和债券的同时,兼顾成长性上市公司的投资,谋求投资组合的流动性,从而为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全,实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略:坚持长期投资的同时加强波段操作,注重投资组合的长、中、短线相结合,适度投资、分散风险;根据行业研究的结果,在个股投资上注重挖掘个股价值和成长性,精选个股,强调组合的成长和价值的平衡。

基金业绩比较基准:无
基金风险收益特征:无

(三)基金管理人:富国基金管理有限公司
信息披露负责人:林志松

(四)基金托管人:交通银行
信息管理人员:张咏东

(五)基金年度报告正文的披露网站:www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司 上海市浦东新区银城中路188号交银金融大厦
交通银行 上海市浦东新区银城中路188号交银金融大厦

上海证券交易 上海市浦东新区南泉东路528号

主要财务指标和基金净值表现

(一)主要财务指标
会计期间:06年1月1日到06年6月30日

Table with 2 columns: 财务指标, 2006年上半年度. Rows include 1. 基金本期净收益, 2. 基金本期净收益, etc.

提示: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,封闭式基金交易佣金等),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. 汉兴证券投资基金历史各时间段份额净值增长率表

Table with 7 columns: 阶段, 净值增长, 净值增长率, 业绩比较基准, etc.

注:由于基金汉兴在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准,此表只列示基金的净值表现。

2. 自基金合同生效以来汉兴证券投资基金累计份额净值增长率历史走势图



注:截止日期为2006年6月30日。由于基金汉兴在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准,此图只列示基金的净值表现。

三、管理人报告
(一)基金管理人及基金经理小组情况

1. 基金管理人
富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立。

2. 基金基金经理
丁加庆先生,生于1974年,经济学硕士,5年证券从业经历,曾任大鹏证券投资基金部项目经理。

(二)遵规守信说明
本报告期,富国基金管理有限公司作为汉兴证券投资基金的基金管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《汉兴证券投资基金基金合同》以及其它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。

(三)对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明与解释
本基金在报告期内净值增长率40.66%,按照晨星分类,报告期内本基金在26个可比股票型基金中排名第21。在报告期内本基金实现了净值的稳定增长,但与同行比存在一定差距,我们将努力通过投资策略调整使本基金下半年实现良好表现。

汉兴基金年初行情判断较为乐观,在大类资产配置上始终保持良好的股票仓位,操作较为成功。

行业配置方面,较为成功的对银行、食品饮料、传媒、商业、电子元器件及私有化板块进行了配置。

(四)对宏观经济、证券市场及行业走势的展望
对于2006年下半年A股市场我们有如下判断:

(1)上半年宏观经济增长加速,宏观调控力度加大。

(2)下半年A股市场震荡加剧,但总体偏暖。

(3)关注3次投资机会

“十一五”期间,国家经济战略将实现重大转型,与此相对应的行业与公司值得重点关注:

1、自主创新类公司的将迎来宽松的生存发展环境,重点看好装备制造、通信设备和软件服务业以及具有自主创新能力的农产品公司。

2、符合消费升级的行业或公司将保持稳定增长,重点关注数字电视、商贸旅游、食品饮料等行业和公司。

3、在美元逐渐走弱和人民币升值步伐将加快背景下,价值重估故事还将继续,我们继续看好银行、有色金属中的锌等品种。

四、托管人报告
2006年上半年,托管人在汉兴证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

2006年上半年,富国基金管理有限公司在汉兴证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等方面上,托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为,基金管理人遵守了《证券投资基金法》等相关法律法规,在各重要方面的运作按照基金合同的规定进行。

2006年上半年,由富国基金管理有限公司编制并经过托管人复核的汉兴证券投资基金的半年度报告中财务指标、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(未经审计)

(一)会计报告书

1. 2006年6月30日资产负债表

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 资产, 银行存款, 清算备付金, etc.

Table with 3 columns: 负债, 期末数, 年初数. Rows include 应付债券, 应付赎回款, 应付赎回费, etc.

基金持有人权益: 3,000,000,000.00

未实现利得: 624,740,188.52

未分配收益: -11,984,222.30

持有者权益合计: 3,612,756,967.22

负债与持有人权益总计: 3,707,933,165.56

所附附注为本会计报表的组成部分

2. 2006年上半年度业绩表现

Table with 3 columns: 项目, 本期数, 上年同期数. Rows include 一、收入, 1. 股票差价收入, etc.

1. 股票差价收入: 538,734,807.18

2. 债券差价收入: 52,952.27

3. 权证差价收入: 11,613,502.57

4. 债券利息收入: 8,432,247.34

5. 存款利息收入: 688,590.31

6. 股利收入: 20,816,308.71

7. 买入返售证券收入: 17,674.02

8. 其他收入: 26,889,388.36

二、费用: 22,389,241.52

1. 基金管理人报酬: 3,728,206.92

2. 基金托管费: 544,046.98

3. 卖出回购证券利息支出: 310,383.21

4. 利息支出: 247,902.94

5. 其他费用: 29,752.78

其中:上市费用: 148,765.71

信息披露费: 49,588.57

审计费用: 4,883.14

银行汇费: 10,960.00

交易所前哨手续费: 3,462.74

债券承销手续费: 511,845,408.82

三、基金净收益: 532,183,980.57

加:未实现利得: -144,660,906.59

四、基金净值变动: 1,044,029,389.29

所附附注为本会计报表的组成部分

3. 2006年上半年度基金收益分配表

Table with 3 columns: 项目, 本期数, 上年同期数. Rows include 本期基金净收益, 加:期初基金净收益, etc.

本期基金净收益: 511,845,408.82

加:期初基金净收益: -623,829,631.12

加:本期损益平准金: -11,984,222.30

减:本期已分配基金净收益: -470,973,776.78

期末基金净收益: -11,984,222.30

所附附注为本会计报表的组成部分

4. 2006年上半年度基金净值变动表

Table with 3 columns: 项目, 本期数, 上年同期数. Rows include 一、期初基金净值, 二、本期经营活动, etc.

期初基金净值: 2,568,726,577.83

二、本期经营活动: 511,845,408.82

基金净收益: 532,183,980.57

经营费用产生的基金净值变动: 1,044,029,389.29

三、本期申购与赎回: 1,044,029,389.29

向基金持有人分配收益产生的基金净值变动: -144,660,906.59

四、期末基金净值: 3,612,756,967.22

所附附注为本会计报表的组成部分

(二)会计报表附注

1. 基金设立说明
汉兴证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证监会证监基金字(1999)28号文《关于同意设立汉兴证券投资基金的批复》,由海通证券股份有限公司、江苏证券有限责任公司(现名为华泰证券股份有限公司)及富国基金管理有限公司于1999年12月30日共同发起并向社会募集设立。

(1)半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

(2)本报告期没有发生重大会计差错。

4. 关联方关系及交易

(1) 关联方关系

企业名称 与本基金的关系

富国基金管理有限公司 基金管理人、基金发起人

交通银行股份有限公司 基金托管人

海通证券股份有限公司 基金发起人、基金管理人的股东

华泰证券股份有限公司 基金发起人

申银万国证券股份有限公司 基金管理人的股东

山东国际信托投资公司 基金管理人的股东

蒙特利尔银行 基金管理人的股东

以下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

Table with 4 columns: 关联方名称, 2006年上半年度, 2005年上半年度. Rows include 股票买卖, 海通证券股份有限公司, etc.

海通证券股份有限公司: 1,081,906,536.89

申银万国证券股份有限公司: 787,286,171.12

债券买卖: 海通证券股份有限公司, 25,290,651.80

申银万国证券股份有限公司: 20,633,087.70

证券回购: 海通证券股份有限公司, 28,290,651.80

申银万国证券股份有限公司: 20,633,087.70

权证买卖: 海通证券股份有限公司, 4,216,790.06

关联方名称: 海通证券股份有限公司

关联方名称: 申银万国证券股份有限公司

关联方名称: 海通证券股份有限公司

关联方名称: 申银