

汉博证券投资基金 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...

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于2006年8月25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...

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代表其未来表现。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:基金汉博
交易代码:500005
运作方式:契约封闭式
基金合同生效日:2000年7月12日

(二)投资目标:投资于具有良好成长性,符合产业发展潮流,对未来经济发展有重要推动作用的新兴产业类上市公司...

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
电话:96105686

(四)基金托管人:中国建设银行股份有限公司(简称“中国建设银行”)
信息管理部:尹东
联系电话:010-67597420

(五)登载半年度报告正文的托管人互联网网址:www.fundgoal.com.cn
基金半年度报告置备地点:

富国基金管理有限公司上海市黄浦区广东路689号通证证券大厦13.14层
中国建设银行 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

上海证券交易所以上海市浦东新区南汇路528号

二、主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 财务指标, 2006年上半年. Rows include 1.基金本期净收益, 2.基金份额本期净收益, 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据。

1. 汉博证券投资基金历史各时间段份额净值增长率表

Table with 5 columns: 期限, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ④-⑥. Rows include 过去一个月, 过去三个月, etc.

注:由于汉博证券投资基金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博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。由于汉博证券投资基金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,是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。

2. 基金经理小组
毕宇宁先生,生于1971年,工商管理硕士,6年证券从业经历,曾任中国北方工业上海公司内资处销售员、兴业证券股份有限公司研究发展中心研究员、富国基金管理有限公司策略部研究员。

(二)遵守声明
本报告期,富国基金管理有限公司作为汉博证券投资基金的托管人严格按照《基金法》、《证券法》、《汉博证券投资基金合同》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,以保护基金份额持有人的利益,并谋求基金资产的长期稳定增值为目标,管理和运用基金资产,无损害基金份额持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

(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为60.91%,按照晨星分类,在28家20亿规模以下封闭式基金中排名第7位。

(四)对宏观经济、证券市场及行业走势的展望
展望下半年,我们认为由于短期市场快速上涨且幅度较大,市场出现一定幅度的调整是正常的,我们重点关注的是:

(1) 宏观政策影响。我们认为,国家进行宏观调控的出发点是为了保证宏观经济稳定运行,调控的措施是结构性的,力度也将是温和的。

(2) “小非”上市的影响。这是“全流通”后证券市场必须面对的,只要真正有投资价值的上市公司,非流通股股东是不会轻易抛出的。

(3) 组合内个股的基本面变化能否跟上股价上涨所带来的估值变化,适时降低比例过高个股的权重,将有助于降低组合风险。

我们下半年将基本保持现有的行业组合配置比例,继续看好银行、电力设备、电子元器件和品牌消费等增长预期明确且估值合理的行业和个股,重点挖掘国家产业政策变化带来的投资机会,特别是行业中具有自主创新能力和国际竞争力的上市公司。

四、托管人报告

汉博基金托管人报告
中国建设银行股份有限公司根据《汉博证券投资基金基金合同》和《汉博证券投资基金托管协议》,托管汉博证券投资基金(以下简称“汉博基金”)。

本报告期,中国建设银行股份有限公司在汉博基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,依法安全保管了基金财产,按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告,不存在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。

本报告期,按照国家有关规定,基金合同、托管协议和其他有关规定,本托管人对基金管理人—富国基金管理有限公司在汉博基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

由汉博基金管理人—富国基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本报告中财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

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
金额单位:人民币元

Balance Sheet table showing assets and liabilities as of June 30, 2006. Assets include bank deposits, clearing fund, etc. Liabilities include management fees, interest, etc.

后附附注为本报财务报表的组成部分。
2.2006年上半年度经营业绩表
金额单位:人民币元

Income Statement table for the first half of 2006. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

后附附注为本报财务报表的组成部分。
3.2006年上半年度收益分配表
金额单位:人民币元

Dividend Distribution table for the first half of 2006. Rows include 一、本期基金净收益, 二、本期可供分配基金净收益, etc.

后附附注为本报财务报表的组成部分。
4.2006年上半年度净值变动表
金额单位:人民币元

Net Asset Value Change table for the first half of 2006. Rows include 一、期初基金净值, 二、本期经营活动, 三、本期基金份额变动, etc.

(二)会计报表附注
1. 会计政策、会计估计及其变更
本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一致。

2. 本基金本期无重大会计差错的内容和更正金额。
3. 关联方关系及其交易

Table showing related party relationships and transactions between the fund and its management, custodian, and other related parties.

(3) 关联方交易
本基金在本报财务报表与关联方进行的关联交易是在正常业务中按照一般商业条款而订立的,且关联交易是按照市场公允价值进行定价的。

A. 通过关联方席位进行的交易
关联方交易 2006年上半年 2005年上半年

Table showing transactions through related party seats for the first half of 2006 and 2005. Columns include 股票买卖, 债券买卖, 权证买卖.

注:上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险金。

股票交易佣金为成交金额的1%,该金额除扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于)

于买(卖)经手费、买(卖)证管费和证券结算风险金等);证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金,但交易的经手费和证管费由本基金交纳,其所计提的证券结算风险金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金的比率是公允的,符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获得的服务主要包括:为本基金提供的证券投资决策研究和市场信息服务。

B. 关联方报酬
① 基金管理人报酬—基金管理费
基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。若本基金持有现金的比例超过资产净值的20%,超出部分不计提基金管理费。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为前一日基金资产净值(扣除本基金持有现金比例超过20%部分的基金资产净值)

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

Table showing management fees for the first half of 2006 and 2005. Columns include 项目, 期初余额(元), 本期计提(元), 本期支付(元), 本期余额(元).

② 基金托管人报酬—基金托管费
基金托管费按前一日基金资产净值的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为前一日基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

Table showing custody fees for the first half of 2006 and 2005. Columns include 项目, 期初余额(元), 本期计提(元), 本期支付(元), 本期余额(元).

③ 与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易
与关联方进行银行间同业市场债券交易明细如下:
本基金2006年上半年及2005年上半年与关联方均未进行银行间同业市场债券交易。

④ 与关联方进行银行间同业市场融资(回购)交易
与关联方进行银行间同业市场融资(回购)交易:
本基金2006年上半年及2005年上半年与关联方未进行银行间同业市场融资(回购)交易。

⑤ 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建设银行保管,并按银行间同业利率计息。由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入明细如下:

Table showing interest income from deposits held by related parties for the first half of 2006 and 2005.

(3) 关联方持有基金份额
A. 基金管理人持有本基金份额
本基金的基金管理人2006年上半年及2005年上半年均未持有本基金份额。

B. 基金管理人的主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额
基金管理人的主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额明细如下:

Table showing shareholdings of related parties in the fund manager for the first half of 2006 and 2005.

(4) 关联方持有基金份额
A. 基金管理人持有本基金份额
本基金的基金管理人2006年上半年及2005年上半年均未持有本基金份额。

B. 基金管理人的主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额
基金管理人的主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额明细如下:

Table showing shareholdings of related parties in the fund manager for the first half of 2006 and 2005.

注:除此外之外,本基金的基金管理人的其他股东及其控制的机构2006年上半年及2005年上半年均未持有本基金份额。

(4) 关联方转让本基金管理人股权情况
基金管理人股东及其控制的机构2006年上半年及2005年上半年均未转让本基金管理人股权。

4. 期末流通受限的基金资产
A. 截至2006年6月30日,因股权分置改革流通受限的基金资产:

Table showing restricted assets as of June 30, 2006. Columns include 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期初公允价值(元), 停牌日期, 复牌日期, 复牌开盘价(元).

B. 截至2006年6月30日,其他原因导致的流通受限的基金资产:

Table showing restricted assets due to other reasons as of June 30, 2006. Columns include 序号, 股票名称, 停牌日期, 上市日, 可流通日, 数量(股), 总成本(元), 受限期间, 估值方法.

(一) 基金资产组合情况
截至2006年6月30日,汉博证券投资基金资产净值为768,366,276.18元,基金份额净值为1.5367元,基金份额累计净值为1.5467元。其资产组合情况如下:

Table showing the asset portfolio of the fund as of June 30, 2006. Columns include 序号, 资产项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%).

(二) 按行业分类的股票投资组合
序号 股票板块名称 市值(元) 市值占基金资产净值比例(%)

Table showing stock investment portfolio by industry for the first half of 2006. Columns include 序号, 股票, 市值(元), 占基金总资产的比例(%).

(三) 报告期末前十名股票投资组合
序号 证券代码 证券名称 数量(股) 市值(元) 市值占基金资产净值比例(%)

Table showing the top 10 stock holdings as of June 30, 2006. Columns include 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(股), 市值(元), 市值占基金资产净值比例(%).

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动
1. 报告期内累计买入价值前20名的股票明细

Table showing the top 20 stock purchases during the first half of 2006. Columns include 序号, 证券代码, 证券名称, 累计买入金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

2. 报告期内卖出价值前20名的股票明细

Table showing the top 20 stock sales during the first half of 2006. Columns include 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

注:上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险金。

本期租用席位的情况:本基金本期续租兴业证券拥有的00V07席位。

9. 本公司于2006年4月8日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站发布了《富国基金管理有限公司关于开通全国统一客户服务热线的公告》,开通全国统一客户服务热线96105686(免长途话费)。

富国基金管理有限公司
二〇〇六年八月二十九日