汉盛证券投资基金 2006年年度报告摘要

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于2007年3月26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。

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）基金名称：汉盛证券投资基金

基金简称：基金汉盛

交易代码：500005

运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：1999年5月10日

报告期末基金份额总额：2,000,000,000.00份

基金合同存续期：15年

基金份额上市交易的证券交易所：上海证券交易所

上市日期：1999年5月18日

（二）投资目标：为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

投资策略："精选品种、组合投资、长线持有、波段操作"，通过研究和发掘具有良好发展前景的上市公司进行组合投资。以长期投资为主轴，同时依据"顺势而为"的原则进行一些短线操作。

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

注册地址：上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦13、14层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

邮政编码：200120

法定代表人：陈敏

信息披露负责人：林志松

电话：95105686、4008880688

传真：021-68597799

电子邮箱：public@fullgoal.com.cn

（四）基金托管人：中国农业银行

注册地址：北京市复兴路甲23号

办公地址：北京市西三环北路100号金玉大厦7—8层

邮政编码：100037

法定代表人：杨明生

信息管理负责人：李芳菲

联系电话：010—68424199

传真：010—68424181

电子邮箱：lifangfei@abchina.com

（五）本基金选用的信息披露报刊：中国证券报、上海证券报、证券时报

登载年度报告正文的管理人互联网网址：www.fullgoal.com.cn

基金年度报告置备地点：

富国基金管理有限公司 上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

中国农业银行 北京市西三环北路100号金玉大厦7—8层

上海证券交易所 上海市浦东南路528号

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

（一）最近三个会计年度的主要会计数据和财务指标

财务指标	2006年	2005年	2004年
1、基金本期净收益	741,071,048.37	-79,226,666.62	217,417,281.24
2、基金份额本期净收益	0.3705	-0.0396	0.1087
3、期末可供分配基金份额收益	0.3196	-0.0509	-0.0113
4、期末基金资产净值	4,119,454,129.51	1,998,767,111.44	1,983,751,369.30
5、期末基金份额净值	2.0597	0.9994	0.9919
6、本期基金份额净值增长率	106.09%	0.76%	-3.33%

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

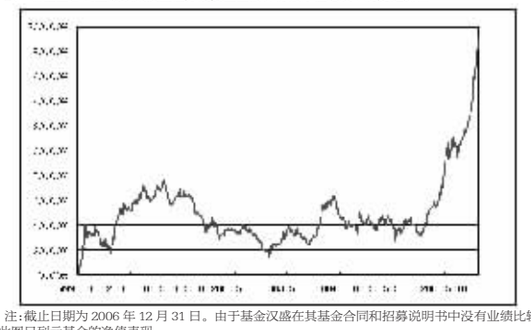
（二）基金净值表现

1、 汉盛证券投资基金历史各时间段份额净值增长率表

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
过去三个月	35.23%	2.19%	-	-	-	-
过去六个月	39.51%	2.22%	-	-	-	-
过去一年	106.09%	2.42%	-	-	-	-
过去三年	100.73%	2.41%	-	-	-	-
过去五年	105.91%	2.16%	-	-	-	-
自基金成立起至今	191.57%	2.33%	-	-	-	-

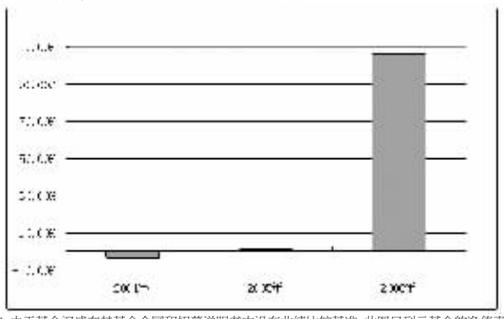
注：由于基金汉盛在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此表只列示基金的净值表现。

2、 自基金合同生效以来汉盛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12月31日。由于基金汉盛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。

3、 汉盛证券投资基金过往三年的年份额净值增长率图



注：由于基金汉盛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）过往三年汉盛证券投资基金收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数	备注
2004年	0.00	未分配
2005年	0.00	未分配
2006年	0.00	未分配
合计	0.00	

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，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于2001年3月从北京迁址上海。2003年9月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截止2006年12月31日，本基金管理人管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、汉鼎证券投资基金、汉博证券投资基金四只封闭式证券投资基金和富国动态平衡证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金七只开放式证券投资基金。

2、 基金经理

李文忠先生，1972年出生，经济学硕士，8年证券从业经历，曾在浙江省交通设计院从事交通工程设计、国信证券有限公司从事企业购并业务和投资分析、曾任鹏华基金管理有限公司基金经理、中国银河证券有限责任公司高级投资经理。

（二）遵规守信说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为汉盛证券投资基金的管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《汉盛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，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，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规及基金合同的规定。

（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106.09%，在可比的26只大型封闭式基金中排名14，按晨星公司评级最近一年风险评价为低。

在股权分置制度变革和强劲的宏观经济的强大推动下，中国股市走出了大幅上升行情，全年上证指数的升幅达到了130.44%。全年的股市基本上是单边上扬，仅在五月中旬到会员月中旬进行了为期三个月但幅度不大的调整。特别在八月下旬之后到年底的阶段，股市进入了持续快速上升的阶段。从投资机会来看，行业角度主要集中于金融、地产、商业、食品饮料、机械等板块，其间有色金属、军工制造等也有出色表现；从风格角度来看，投资机会集中于绩优大盘股上，而大量的绩差、低价类个股全年基本没有什么表现。2006年是基金的丰收年，若去除仓位因素的制约，大部分基金的股票部分投资收益都超过了指数的表现，基金的规模也获得了大幅增长。

在全年的投资过程中，汉盛基金始终坚持严格的价值投资理念，从公司的基本投资价值优龙其是长期投资价值角度选择成长型个股进行投资，坚持适度均衡的资产配置，同时注重利用Barra系统等金融工具将组合的关键风险指标始终控制在适度的范围内，追求以较低的风险，以持续而小幅的超额收益达到长期累积收益率在基金中各列前茅的目标，最终为投资者提供较好的回报。

具体的投资来说，本基金全年的投资过程有如下的特点：（1）全年里均坚持重仓的策略。在大部分时间里，本基金对后市都持乐观的态度，股票投资比例保持在上限，基本都处于满仓状态；（2）行业配置上重点投资了银行、食品饮料、商业、汽车零部件、地产等持续增长性较好的行业，低配置的主要是汽车、钢铁、有色、机械、交通运输等行业；（3）积极参与网下增发个股的投资，对于本来就愿以市价买入并较长时间投资的个股，可以较低的价格进行网下增发认购，是比较好的获利方式；（4）本基金注重利用金融工程控制投资风险，主要风险指标始终控制在封闭式基金中最低之一，如果考虑风险调整后的收益因夏普比率（晨星），则汉盛的排名将大幅提升。

（四）对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

经过2006年的大幅上涨之后，展望2007年，本基金认为市场存在较多的变数。与2006年初不同，当时优质个股股价十分低迷，与H股股价相比，普遍存在较大的折价，但在股价大幅上涨之后，与H股相比，大部分股价都已经存在较大的溢价。本基金认为蓝筹股的股价已基本合理，未来的收益主要来源于以下几方面，一是赚取时间的钱，即随着利润的增长获得正常的利润；二是部分公司持续快速的增长所带来的超额利润；三是通过一定的泡沫带来收益，但风险也较大；四是通过下跌之后带来收益。而对于现在的低价股上涨，本基金认为有其合理性，因为随着股改完成和全流通的制度变革，资产重组和优质资产注入成为很多劣质公司发展的必由之路，相关各方的动力也较大。但这种重组成功的仅是少部分，大部分个股都是投机性上涨，大非的流通将是这些个股最大的压力。

尽管难度加大、获利预期降低，但本基金认为2007年的中国股市仍然充满机会，优质的个股仍会在有利的宏观经济中获得强劲的增长，即使是平稳较快增长的公司也可通过长期持有而获得不错的回报。尤其是在低利率、人币持续升值、良好的宏观经济背景下，股市极有可能在适度回调后迈向泡沫阶段，这也可为今年的投资者带来不错的回报，但要注意控制风险。

（五）内部监察报告

2006年，本基金管理人在总结去年基金运作的基础上，继续坚持"事先防范"为主的内部控制策略，坚持规范经营、合规运作，重视公司和基金运作的风险管理，内部监察工作坚持一切从防范风险，保障基金持有人利益出发，内部风险管理部门和各业务部门紧密配合，继续通过进一步完善规章制度和业务流程、加强基金投资限制的系统控制功能和日常监控、组织定期的法律法规培训和定期、不定期内控检查等方式，对公司各项工作进行全方位、实时的监察稽核，并对基金投资决策与执行情况进行重点专项监察稽核。

在本报告期内，管理人对本基金运作实施内部控制措施如下：

1、继续强化对本基金日常投资运作合法性、合规性及遵守基金合同情况的监控，完善投资规章制度和业务流程。

公司在进一步完善投资管理工作各项制度的基础上，重点修订了股票库管理制度、流通受限品种投资管理制度等相关制度，投资管理的相关工作职责和业务流程更加清晰和明确，进一步提高了投资风险管理能力。

进一步改进和提高公司交易系统的基金投资控制功能，加强了监察稽核对基金投资的事前控制能力。

进一步加强投资流程电子化和研究量化工作，实现股票出入库管理流程电子化及研究和交易考核量化，提高了业务审批效率，提供了可供采集的业务数据。其中，网下新股申购、增发等特殊业务须经监察稽核部电子审批，便于及时、有效地对投资管理工作进行监察和稽核。

公司开发了新的风险管理业务模板，实现了投资项目开仓、流通受限证券申购、权证投资的电子化事前风险控制和基金投资日常监控报告的自动化管理，提高了基金投资日常监控工作的效率。在此基础上，监察稽核部加大了对投资风险日常提示的频率，确保相关风险得到有效控制。

2、进一步完善公司制度，控制公司运作风险。

2006年，公司在2005年开始的制度修订工作的基础上，结合相关法律法规和业务实际以及制度试行情况对公司制度和业务流程进行修订和完善，进一步细化了各业务环节协作、监督和信息沟通的运作流程。

公司以后台运作协调小组为依托，定期和不定期对公司运营中出现的问题进行磋商并提出解决方案。

3、提高公司员工特别是投资人员法律意识、强调有效风险管理下的基金投资。

公司组织相关人员对不时公布的法律法规进行学习、培训，并通过考试检查学习效果。通过上述工作的开展，公司提高了投资风险管理的效率。

公司通过定期监察稽核、风险控制委员会会议等形式检查、监督"研究为本、淡化选时、均衡配置、风险管理"的投资理念的落实、执行情况坚持以风险调整后的收益作为评价投资业绩的指标、以均衡投资为投资团队统一的投资理念。

4、继续加强风险管理，做好风险绩效报告工作

2006年公司进一步强化基金投资的量化风险评估工作，通过月度报告和季度报告的形式，定期对基金投资的流动性风险、持股集中度、股票库表现等问题进行了分析，为管理投资风险提供依据。

我们认为，建立并切实运行科学严密的内部控制体系，对揭示和防范风险，保障基金投资的科学、高效，提高公司管理水平至关重要。我们将继续高度重视防范各种风险，不断完善和优化操作流程，充实和改进内控技术方法与手段，提高内部监察工作的科学性和效率性，切实保障基金运作的安全。

四、托管人报告

在托管汉盛证券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《汉盛证券投资基金基金合同》、《汉盛证券投资基金托管协议》的约定，对汉盛证券投资基金管理人—富国基金管理有限公司2006年1月1日至2006年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为，富国基金管理有限公司在汉盛证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人认为，汉盛证券投资基金的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的汉盛证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行基金托管业务部

2007年3月26日

五、审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。

六、财务会计报告

（一）会计报告书

1、2006年12月31日资产负债表 金额单位：人民币元

项 目	年末数	年初数
资 产：		
银行存款	337,237,644.13	48,206,411.73
清算备付金	7,598,386.65	1,696,762.84
交易保证金	660,000.00	660,000.00
应收证券清算款		
应收股利		
应收利息	5,329,752.38	5,106,326.61
应收申购款		
其他应收款	25,960,024.36	24.36
股票投资市值	3,190,001,555.16	1,519,521,067.64
其中：股票投资成本	1,736,675,776.97	1,420,496,905.13
债券投资市值	873,218,949.08	438,900,971.80
其中：债券投资成本	857,420,007.18	437,378,455.84
权证投资	11,406,983.55	0.00
其中：权证投资成本	369,055.47	0.00
买入返售证券		
待摊费用		
其他资产		
资产合计	4,451,413,295.31	2,014,091,564.98
负债及基金持有人权益		
负 债：		
应付证券清算款	323,661,511.02	10,150,497.72
应付赎回款		
应付赎回费		
应付管理人报酬	4,864,320.19	2,442,201.20
应付托管费	810,720.00	407,033.49
应付佣金	1,113,740.67	815,847.21
应付利息		
应付收益		
未交税金		
其他应付款	1,408,873.92	1,408,873.92
卖出回购证券款		
预提费用	100,000.00	100,000.00
其他负债		
负债合计	331,959,165.80	15,324,453.54
持有人权益：		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得	1,480,162,648.17	100,546,678.47
未分配收益	639,291,481.34	-101,779,567.03
持有人权益合计	4,119,454,129.51	1,998,767,111.44
负债及基金持有人权益合计	4,451,413,295.31	2,014,091,564.98

后附附注为本会计报表的组成部分

2、2006年度经营业绩表 金额单位：人民币元

项 目	本年数	上年数
一、收入	794,095,619.22	-43,763,948.56
1、股票差价收入	729,350,498.31	-93,373,716.30
2、债券差价收入	925,431.97	4,607,610.96
3、权证差价收入	16,808,971.87	2,752,746.47
4、债券利息收入	16,327,099.40	13,481,749.92
5、存款利息收入	1,430,191.78	686,702.34
6、股利收入	29,221,206.72	28,065,727.30
7、买入返售证券收入		
8、其他收入	32,219.17	15,230.75
二、费用	53,024,570.85	35,462,718.06
1、基金管理人报酬	41,748,357.77	29,576,735.94
2、基金托管费	6,958,059.53	4,929,456.01
3、卖出回购证券支出	3,774,330.66	454,871.34
4、利息支出		
5、其他费用	543,822.89	501,654.77
其中：上市年费	60,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
审计费用	100,000.00	100,000.00
三、基金净收益	741,071,048.37	-79,226,666.62
加：本期末实现利得	1,379,615,969.70	94,242,408.76
四、基金经营业绩	2,120,687,018.07	15,015,742.14

后附附注为本会计报表的组成部分

3、2006年度收益分配表 金额单位：人民币元

项 目	本年数	上年数
本期基金净收益	741,071,048.37	-79,226,666.62
加：期初基金净收益	-101,779,567.03	-22,552,900.41
加：以前年度损益调整		
可供分配基金净收益	639,291,481.34	-101,779,567.03
减：本期已分配基金净收益		
期末基金净收益	639,291,481.34	-101,779,567.03

后附附注为本会计报表的组成部分

4、2006年度净值变动表 金额单位：人民币元

项 目	本年数	上年数
一、期初基金净值	1,998,767,111.44	1,983,751,369.30
二、本期经营活动		
基金净收益	741,071,048.37	-79,226,666.62
未实现利得	1,379,615,969.70	94,242,408.76
经营活动产生的基金净值变动数	2,120,687,018.07	15,015,742.14
三、以前年度损益调整		
四、本期向持有人分配收益		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		
五、期末基金净值	4,119,454,129.51	1,998,767,111.44

后附附注为本会计报表的组成部分。

（二）会计报表附注

1、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。

3、关联方关系及其交易

（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
中国农业银行	基金托管人
海通证券股份有限公司（"海通证券"）	基金发起人、基金管理人的股东
申银万国证券股份有限公司（"申银万国"）	基金发起人、基金管理人的股东
山东省国际信托投资公司（"山东国投"）	基金发起人、基金管理人的股东
华泰证券有限责任公司	基金发起人
福建企业投资国际集团	基金发起人
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

关联方名称	2006年度		2005年度	
股票投资	年成交金额	占全年交易金额的比例	年成交金额	占全年交易金额的比例
海通证券	1,384,214,760.60	19.37%	657,715,798.36	17.01%
申银万国	1,386,013,750.26	19.40%	772,695,224.77	19.98%
债券投资	年成交金额	占全年交易金额的比例	年成交金额	占全年交易金额的比例
海通证券	111,048,584.80	22.89%	10,978,908.40	3.34%
申银万国	85,124,610.90	17.55%	94,010,368.00	28.64%
权证投资	年成交金额	占全年交易金额的比例	年成交金额	占全年交易金额的比例
海通证券	2,236,124.33	13.30%	1,492,873.54	54.23%
申银万国	9,479,494.47	56.39%		
债券回购	年成交金额	占全年交易金额的比例	年成交金额	占全年交易金额的比例
海通证券	247,000,000.00	6.17%	170,000,000.00	32.20%
申银万国	1,902,500,000.00	47.51%		
佣金	2006年度			
	年佣金	占全年佣金总量的比例	年末余额	占该应付佣金比例
海通证券	1,117,196.24	19.41%	207,617.68	18.64%
申银万国	1,107,935.21	19.25%	224,354.63	20.14%
佣金	2005年度			
	年佣金	占全年佣金总量的比例	年末余额	占该应付佣金比例
海通证券	529,492.84	16.93%	53,109.90	6.51%
申银万国	621,110.48	19.86%	121,002.46	14.83%

注：(1) 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基金。

(2) 股票交易佣金为成交金额的1‰扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费和证券结算风险基金等）；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基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取的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2006年5月26日，本基金申购我公司股东海通证券股份有限公司承销的泰豪科技股份有限公司增发的股份6018143股，申购价格为7.47元；2006年5月31日，本基金作为泰豪科技股份有限公司的原股东参与了泰豪网上向原股东的定价发行，申购数量为65721股，申购价格为7.47元，特此说明。

2006年8月30日，本基金作为原股东参与了招商局地产控股股份有限公司发行的可转换公司债的网上增配，数量为152094（张），价格为100元，我公司股东海通证券股份有限公司为其分销商。

2006年11月16日，本基金网下申购我公司股东海通证券股份有限公司副主承销的马鞍山钢铁股份有限公司认股权和债券分离交易的可转换公司债券22890（张），申购价格为100元，特此说明。

（3）关联方报酬

A 基金管理人报酬——基金管理费

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，基金成立三个月后，如持有现金的比例超过资产净值的20%，超过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为前一日的基金资产净值（扣除本基金持有现金比例超过20%部分的基金资产净值）

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至至每月最后一个工作日（遇公众假期延至节假日结束后的第一个工作日），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。

项 目	期初余额	本期计提	本期支付	期末余额
2006年度	2,442,201.20	41,748,357.77	39,326,238.78	4,864,320.19
2005年度	2,544,104.86	29,576,735.94	29,678,639.60	2,442,201.20

B 基金托管人报酬——基金托管费

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月最后一个工作日（遇公众假期延至节假日结束后的第一个工作日），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。

项 目	期初余额	本期计提	本期支付	期末余额
2006年度	407,033.49	6,958,059.53	6,554,373.02	810,720.00
2005年度	424,017.48	4,929,456.01	4,946,440.00	407,033.49

C 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农业银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入如下：

项目	2006-12-31	2005-12-31
银行存款余额	337,237,644.13	48,206,411.73
项目	2006年度	2005年度
银行存款产生的利息收入	1,338,890.09	592,483.76

（4）与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金2006年度通过银行间同业市场与关联方进行的债券（含回购）交易如下：

与基金托管人中国农业银行未进行银行间债券交易；

与基金托管人中国农业银行进行的融资回购业务交易金额为人民币1,338,230,000.00元，相应的利息支出为人民币538,011.04元；

本基金2005年度通过银行间同业市场与关联方进行的债券（含回购）交易如下：

向基金托管人中国农业银行卖出银行间债券金额为人民币15,313,500.00元，相应的债券买卖差价收入为人民币311,812.50元；

与基金托管人中国农业银行进行的融资回购业务交易金额为人民币935,200,000.00元，相应的利息支出为人民币234,972.00元；

向基金管理人的股东申银万国证券股份有限公司购入银行间债券金额为人民币169,895,000.00元。

（5）关联方持有基金份额

A 基金管理人所持有的本基金份额

	富国基金管理有限公司	
	2006年度	2005年度
年初持有基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
加：本年增加		
减：本年减少		
年末持有基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
占年末基金总份额的比例	0.50%	0.50%

B 基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额

本基金的基金管理人主要股东于2005年及2006年年末持有的本基金份额余额如下：

	2006-12-31	2005-12-31
海通证券股份有限公司	5,000,000.00	10,000,000.00
申银万国证券股份有限公司	10,000,000.00	10,000,000.00
山东省国际信托投资有限公司	5,000,000.00	5,000,000.00
华泰证券有限责任公司	5,000,000.00	5,000,000.00
福建企业投资国际集团	5,000,000.00	5,000,000.00

除此之外，本基金的其他关联方于2006年及2005年年末均未持有本基金份额。

4、期末流通受限的基金资产

A.截至2006年12月31日，本基金流通受限制的基金资产明细如下：

序号	股票代码	股票名称	申购日期	上市日期	可流通日期	数量（股）	总成本（元）	总市值（元）	受限原因	估值方法
1	002070	众和股份	2006-9-20	2006-10-12	2007-1-12	26,664	235,700.76	366,896.64	新股网下申签锁定期未上市	市价
2	002071	江苏宏宝	2006-9-21	2006-10-12	2007-1-12	51,209	198,690.92	358,463.00	新股网下申签锁定期未上市	市价
3	002072	德棉股份	2006-9-22	2006-10-18	2007-1-18	93,547	303,092.28	470,541.41	新股网下申签锁定期未上市	市价
4	002073	青岛软控	2006-9-28	2006-10-18	2007-1-18	14,306	387,556.00	704,755.68	新股网下申签锁定期未上市	市价
5	002074	东源电器	2006-9-27	2006-10-18	2007-1-18	21,211	167,142.68	298,014.55	新股网下申签锁定期未上市	市价
6	002075	真新家纺	2006-10-12	2006-10-25	2007-1-25	79,689	338,678.25	752,264.16	新股网下申签锁定期未上市	市价
7	002076	雪莱特	2006-10-12	2006-10-25	2007-1-25	16,279	111,673.94	305,882.41	新股网下申签锁定期未上市	市价
8	002077	大港股份	2006-11-1	2006-11-16	2007-2-16	65,825	348,872.50	568,728.00	新股网下申签锁定期未上市	市价
9	002078	太阳纸业	2006-11-3	2006-11-16	2007-2-16	126,232	2,108,074.40	2,408,506.56	新股网下申签锁定期未上市	市价
10	002079	苏州固锝	2006-11-1	2006-11-16	2007-2-16	26,788	171,124.20	274,762.80	新股网下申签锁定期未上市	市价
11	002080	中材科技	2006-11-7	2006-11-20	2007-2-26	24,628	221,159.44	480,738.56	新股网下申签锁定期未上市	市价
12	002081	金螳螂	2006-11-6	2006-11-20	2007-2-26	18,423	235,814.40	443,625.84	新股网下申签锁定期未上市	市价
13	002082	栋梁新材	2006-11-7	2006-11-20	2007-2-26	32,298	205,415.28	401,464.14	新股网下申签锁定期未上市	市价
14	002083	孚日股份	2006-11-14	2006-11-24	2007-2-26	106,373	711,635.37	916,935.26	新股网下申签锁定期未上市	市价
15	002084	海鸥卫浴	2006-11-14	2006-11-24	2007-2-26	35,152	282,270.56	788,107.84	新股网下申签锁定期未上市	市价
16	002085	万丰奥威	2006-11-15	2006-11-28	2007-2-28	108,190	612,355.40	789,787.00	新股网下申签锁定期未上市	市价
17	002086	东方海洋	2006-11-14	2006-11-28	2007-2-28	32,837	245,949.13	382,879.42	新股网下申签锁定期未上市	市价
18	002087	新野纺织	2006-11-21	2006-11-30	2007-3-1	188,209	976,804.71	1,151,839.08	新股网下申签锁定期未上市	市价
19	002088	鲁阳股份	2006-11-21	2006-11-30	2007-2-28	19,458	214,038.00	524,393.10	新股网下申签锁定期未上市	市价
20	002089	新海宜	2006-11-21	2006-11-30	2007-2-28	22,988	198,036.88	308,031.96	新股网下申签锁定期未上市	市价
21	002090	金智科技	2006-11-28	2006-12-8	2007-3-8	13,507	192,935.40	301,087.92	新股网下申签锁定期未上市	市价
22	002093	国脉科技	2006-12-6	2006-12-15	2007-3-15	12,038	121,563.60	243,949.72	新股网下申签锁定期未上市	市价
23	002094	青岛金王	2006-12-6	2006-12-15	2007-3-15	27,688	212,920.72	329,487.20	新股网下申签锁定期未上市	市价
24	002097	山河智能	2006-12-12	2006-12-22	2007-3-22	25,786	257,880.00	839,850.02	新股网下申签锁定期未上市	市价
25	002099	海翔药业	2006-12-13	2006-12-26	2007-3-26	40,828	471,971.68	651,614.88	新股网下申签锁定期未上市	市价
26	002100	天康生物	2006-12-13	2006-12-26	2007-3-26	20,206	219,426.30	383,086.80	新股网下申签锁定期未上市	市价
27	002101	广东宏图	2006-12-20	2006-12-29	2007-3-29	17,212	196,388.92	331,847.36	新股网下申签锁定期未上市	市价
28	002102	冠福家用	2006-12-20	2006-12-29	2007-3-29	29,192	173,984.32	316,733.20	新股网下申签锁定期未上市	市价
29	002103	广博股份	2006-12-27	2007-1-10	2007-4-10	134,304	886,406.40	886,406.40	新股未上市	成本
30	002104	恒宝股份	2006-12-27	2007-1-10	2007-4-10	59,342	500,253.06	500,253.06	新股未上市	成本
31	002105	信隆实业	2006-12-27	2007-1-12	2007-4-12	182,911	621,897.40	621,897.40	新股未上市	成本
32	002106	莱宝高科	2006-12-27	2007-1-12	2007-4-12	179,301	3,586,020.00	3,586,020.00	新股未上市	成本
33	600017	日照港	2006-9-26	2006-10-17	2007-1-18	255,339	1,200,093.30	1,833,334.02	新股网下申签锁定期未上市	市价
34	601006	大秦铁路	2006-7-26	2006-8-1	2007-2-1	1,948,600	9,645,570.00	15,764,174.00	新股网下申签锁定期未上市	市价
35	601333	广深铁路	2006-12-18	2006-12-22	2007-3-22	2,705,280	10,171,852.80	19,396,857.60	新股网下申签锁定期未上市	市价
36	601588	北辰实业	2006-9-26	2006-10-16	2007-1-16	539,272	1,294,282.80	3,634,693.28	新股网下申签锁定期未上市	市价
37	601628	中国人寿	2006-12-28	2007-1-9	2007-1-9 2007-4-9	109,000 454,220	2,057,920.00 8,575,862.40	2,057,920.00 8,575,862.40	网上新股未上市 新股网下申签	成本
38	601666	平煤天安	2006-11-10	2006-11-23	2007-2-26	767,742	6,264,774.72	8,230,194.24	新股网下申签锁定期未上市	市价
39	601872	招商轮船	2006-11-23	2006-12-1	2007-3-1	1,547,860	5,742,560.60	12,382,880.00	新股网下申签锁定期未上市	市价
40	601988	中国银行	2006-6-28	2006-7-5	2007-1-5	2,122,068	6,535,963.28	11,183,287.52	新股网下申签锁定期未上市