汉鼎证券投资基金 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。

基金托管人中国工商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：汉鼎证券投资基金

基金简称：基金汉鼎

交易代码：500025

运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2000 年 6 月 30 日

报告期末基金份额总额：500，000，000.00 份

基金合同存续期：至 2008 年 12 月 31 日

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：2000 年 8 月 17 日

（二）投资目标：通过注重投资符合国家产业发展方向的信息技术以及运用信息技术对传统产业进行改造，提升经营效率的上市公司，从而实现长期资本增值，充分注重投资组合的成长性并兼顾流动性，同时通过投资组合等措施减少和分散投资风险，确保基金资产的安全。

投资策略：本基金是积极成长型基金，遵守资产配置的均衡原则、适度集中、组合投资、坚持以基本面研究驱动投资的基础上注重波段操作，获取最大收益。

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：中国工商银行股份有限公司（以下简称："工商银行"）

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码：100032

法定代表人：姜建清

信息管理负责人：蒋松云

电话：010—66106912

传真：010—66106904

电子邮箱：custody@icbc.com.cn

（五）本基金选用的信息披露报刊：中国证券报、上海证券报

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

中国工商银行 北京市西城区复兴门内大街 55 号

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
基金本期净收益	175,030,070.43 元	12,254,799.26 元	38,002,283.99 元
基金份额本期净收益	0.3501 元	0.0245 元	0. 0760 元
期末可供分配基金份额收益	0.2415 元	-0.1086 元	-0.1331 元
期末基金资产净值	888,550,000.89 元	457,466,977.92 元	446,396,115.04 元
期末基金份额净值	1.7771 元	0.9149 元	0.8928 元
本期基金份额净值增长率	94.24%	2.48%	3.47%

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。

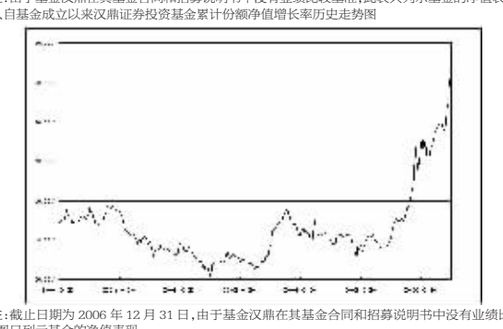
（二）基金净值表现

1、汉鼎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	22.13%	2.23%	-	-	-	-
过去六个月	27.85%	2.40%	-	-	-	-
过去一年	94.24%	2.95%	-	-	-	-
过去三年	105.95%	2.56%	-	-	-	-
过去五年	100.12%	2.32%	-	-	-	-
自基金成立起至今	78.67%	2.19%				

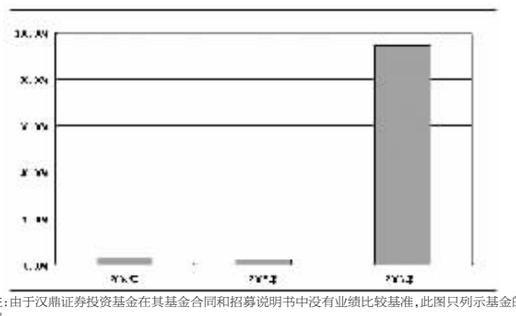
注：由于基金汉鼎在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此表只列示基金的净值表现。

2、自基金成立以来汉鼎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，由于基金汉鼎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、汉鼎证券投资基金过往三年的年净值增长率图



注：由于汉鼎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）过往三年汉鼎证券投资基金收益分配情况

过往三年本基金未进行收益分配。

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

宋小龙先生，1972 年出生，硕士研究生；曾任北京北大青鸟有限责任公司项目开发经理、富国基金管理有限公司信息技术部项目开发经理、研究员、高级研究员。

（二）遵规守信说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为汉鼎证券投资基金的管理人按照《基金法》、《证券法》、《汉鼎证券投资基金合同》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，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期曾经出现过买入基金托管人发行股票的情况，基金管理人及时发现并进行了处理。运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

（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 94.24%，按照晨星分类，报告期内本基金在同类型 27 个封闭式基金中排名第 21，最近一年风险评价为中。在报告期内，单纯从基金净值的绝对增长率来看，似乎还较为理想，但相对同类型的其他封闭式基金的业绩而言，本基金的业绩表现不甚理想。

2006 年的中国股市展现了一轮波澜壮阔的牛市行情，其力度、深度、广度、强度都远远超出了市场预期。根据基金合同规定，本基金通过对符合国家产业发展方向的信息技术类上市公司的投资而实现长期资本增值，充分注重投资组合的成长性并兼顾流动性，同时通过投资组合等措施减少和分散投资，投资于信息技术类上市公司的资产比例不低于整体股票资产的 70%。从 2006 年的市场发展历程来看，上半年曾经有一段时期信息技术产业整体表现良好，本基金业绩表现也相对较好，而从下半年开始，金融、地产作为市场的核心资产表现极其强势，本基金虽然也在力所能及的范围内进行了一定程度的调整，但终究正面影响有限，导致业绩表现相对落后。尽管基金合同对基金的投资产生了一定的影响，但值得注意的是，2006 年也有一些信息技术类上市公司的股票走出了长期上升趋势，从这个角度来说，基金管理人的个股挖掘和研究能力需要进一步提高。

（四）对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

我们坚定认为，宏观经济的持续向好，以及上市公司业绩的持续增长，是股票市场走牛的根本因素。特别是随着工商银行、中国银行、中国人寿等大盘蓝筹股的上市，中国股市作为宏观经济晴雨表的作用日益显著。我们看好中国宏观经济的持续发展，随着中国股市制度性缺陷的解决，股市的长期向好可以期待。但是值得注意的是，2006 年整体市场上升幅度巨大，相当数量的上市公司估值已经不是特别具有吸引力。虽然 2007 年的市场仍然会维持在相当高的热度当中，但是期待市场走出 2006 年的单边强势上升情可能偏于乐观。我们更倾向于认为 2007 年的市场会呈现强势平衡的态势。

对于本基金重点投资的信息技术产业，我们认为行业整体性机会可能依然偏小，但是随着中国宏观经济增长质量的改善，相当数量的电子技术制造类企业也面临一个产业升级的过程，其核心竞争力已经逐步从"低成本制造"向"低研发成本"方向演进，产品路线呈现高端化的趋势，在国际市场的地位日趋提高，业绩持续增长可以期待，相应的二级市场股票价格也会有良好的表现。

同时，中国 3G 产业发展政策的逐渐明朗也会带来一定的投资机会。而中国电信运营商之间有可能进行的重组，也许会成为 2007 年在中国股市实现全流通之后最为引市场关注的并购案件，其中的投资机会以及具体的创新方式都值得重点期待。

本基金管理人将秉承富国基金"亲力亲为，奉献社会"的企业宗旨，在 2007 年勤勉尽责，规范运营，努力为基金持有人创造良好的收益。

四、托管人报告

汉鼎证券投资基金托管人报告

2006 年度，本托管人在对汉鼎证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

2006 年度，汉鼎证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在汉鼎证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作基本按照有关法律法规、基金合同的规定进行。

2006 年度，汉鼎证券投资基金因证券市场波动发生过不符合投资比例限制的情况，出现一次买入托管人发行的股票的情况，我行向富国基金管理公司发送了提示函件，富国基金管理公司在规定时间内及时对投资组合进行了调整。

本托管人依法对富国基金管理有限公司在 2006 年度所编制和披露的汉鼎证券投资基金年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

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

资　产	年　初 余　额	期　末 余　额
资 产：		
银行存款	34,088,518.22	15,983,449.72
清算备付金	148,011.27	3,731,160.29
交易保证金	348,780.49	348,780.49
应收证券交易清算款		
应收股利		
应收利息	1,015,800.92	1,261,654.57
应收申购款		
其他应收款		
股票投资市值	336,950,334.85	687,079,812.58
其中:股票投资成本	325,838,279.32	419,545,360.02
债券投资市值	94,027,660.00	183,488,516.80
其中:债券投资成本	93,394,103.92	183,224,405.21
权证投资市值		
其中:权证投资成本		
买入返售证券		
待摊费用		
其他资产		
资产合计：	466,579,105.75	891,893,374.45
负债及持有人权益	年　初 余　额	期　末 余　额
负债：		
应付证券清算款	7,727,350.89	1,272,950.70
应付赎回款		
应付赎回费		
应付管理人报酬	559,258.84	1,054,364.69
应付托管费	93,209.82	175,727.45
应付佣金	314,451.24	440,556.06
应付利息		
应付收益		
未交税金		
其他应付款	367,857.04	349,774.66
卖出回购证券款		
短期借款		
预提费用	50,000.00	50,000.00
其他负债		
负债合计	9,112,127.83	3,343,373.56
持有人权益：		
实收基金	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	11,745,611.61	267,798,564.15
未分配收益	-54,278,633.69	120,751,436.74
持有人权益合计	457,466,977.92	888,550,000.89
负债与持有人权益总计	466,579,105.75	891,893,374.45

所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	本期数	上年同期数
一、收入	187,619,867.89	20,537,138.67
1、股票差价收入	175,524,282.24	9,145,376.05
2、债券差价收入	-103,802.15	650,009.14
3、权证差价收入	1,968,269.58	475,958.68
4、债券利息收入	3,820,930.27	2,761,102.92
5、存款利息收入	353,154.59	260,605.70
6、股利收入	6,057,033.36	7,205,188.32
7、买入返售证券收入		
8、其他收入		38,897.86
二、费用	12,589,797.46	8,282,339.41
1、基金管理人报酬	9,576,344.80	6,650,272.56
2、基金托管费	1,596,057.49	1,108,378.72
3、卖出回购证券利息支出	1,062,735.23	171,394.90
4、利息支出		
5、其他费用	354,659.94	352,293.23
其中:上市年费	60,000.00	60,000.00
信息披露费	200,000.00	200,000.00
审计费用	50,000.00	50,000.00
三、基金净收益	175,030,070.43	12,254,799.26
加:未实现利得	256,052,952.54	-1,183,936.38
四、基金经营业绩	431,083,022.97	11,070,862.88

所附附注为本会计报表的组成部分

3、2006 年度基金收益分配表　　金额单位：人民币元

项目	本期数	上年同期数
本期基金净收益	175,030,070.43	12,254,799.26
加:期初基金净收益	-54,278,633.69	-66,533,432.96
加:本期损益平准金		
加:以前年度损益调整		
可供分配基金净收益	120,751,436.74	-54,278,633.69
减:本期已分配基金净收益		
期末基金净收益	120,751,436.74	-54,278,633.69

所附附注为本会计报表的组成部分

4、2006 年度基金净值变动表　　金额单位：人民币元

项目	本期数	上年同期数
一、期初基金净值	457,466,977.92	446,396,115.04
二、本期经营活动:		
基金净收益	175,030,070.43	12,254,799.26
未实现利得	256,052,952.54	-1,183,936.38
经营活动产生的基金净值变动数	431,083,022.97	11,070,862.88
三、以前年度损益调整:		
以前年度损益调整产生的基金净值变动数		
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	888,550,000.89	457,466,977.92

所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、重大关联方、关联方交易及关联方报酬

（1）关联方

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、注册登记人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托投资有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

（2）通过关联方席位进行的交易

关联方名称	2006年度		2005年度	
股票买卖	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
申银万国	491,939,074.51	24.92%	302,869,927.52	22.16%
海通证券	448,255,691.61	22.71%	386,441,983.37	28.27%
债券买卖	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
申银万国	41,337,670.40	29.30%	10,793,893.48	8.37%
海通证券	38,163,310.10	27.05%	48,293,284.00	37.46%
权证买卖	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
申银万国	489,085.33	24.85%	76.96	100%
证券回购	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
申银万国	224,500,000.00	14.78%	13,000,000.00	7.74%
海通证券	662,000,000.00	43.58%	116,000,000.00	69.09%

	2006年度			
佣金	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
申银万国	390,549.54	24.59%	90,966.27	20.65%
海通证券	363,636.68	22.90%	155,433.69	35.28%

	2005年度			
佣金	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	315,351.68	28.51%	147,252.55	46.83%
申银万国	242,891.07	21.96%	49,584.86	15.77%

注：(1)上述佣金未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)上述买卖证券成交额包括股票买卖、债券买卖及回购金额。(3)股票交易佣金为成交金额的 1%，该金额应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货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。1%o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：有关宏观经济形势与经济政策、国内外金融市场动态、行业与上市公司动态以及各类专题研究报告等内容的一揽子研究成果。

（3）基金管理人报酬——基金管理费

支付基金管理人富国基金管理有限公司的管理人报酬按前一日的基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。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。其计算公式为：日基金管理费＝前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

	期初余额（元）	本期计提（元）	本期支付（元）	本期余额（元）
2006年度	559,258.84	9,576,344.80	9,081,238.95	1,054,364.69
2005年度	574,175.91	6,650,272.56	6,665,189.63	559,258.84

（4）基金托管人费用

支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

	期初余额（元）	本期计提（元）	本期支付（元）	本期余额（元）
2006年度	93,209.82	1,596,057.49	1,513,539.86	175,727.45
2005年度	95,695.97	1,108,378.72	1,110,864.87	93,209.82

（5）与关联方进行的其他交易

本基金于 2006 年度通过银行间同业市场向基金管理人的股东中国工商银行股份有限公司购入银行间债券金额为人民币 30,446,386.44 元。

本基金于 2005 年度通过银行间同业市场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 19,990,000.00 元。

（6）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工商银行股份有限公司保管，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如下：

项目	2006-12-31	2005-12-31
银行存款余额	15,983,449.72	34,088,518.22
项目	2006年度	2005年度
银行存款产生的利息收入	323,271.48	238,365.06

（7）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	1,250,000.00	1,250,000.00
加:本年增加	-	-
減:本年減少	-	-
年末持有基金份额	1,250,000.00	1,250,000.00
占年末基金总份额的比例	0.25%	0.25%

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的主要股东申银万国证券股份有限公司于 2005 年及 2006 年年末持有本基金份额余额情况如下：

	2006-12-31	2005-12-31
申银万国证券股份有限公司	2,500,000.00	2,500,000.00

除此之外，2006 年及 2005 年年末本基金的基金托管人、基金管理人其他主要股东及其控制的机构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，本基金持有的因股权分置改革流通受限的基金资产明细如下：：

股票代码	股票名称	数量	投资成本	年末估值单价	年末估值总额	停牌日期（年/月/日）	复牌日期（年/月/日）	复牌开盘单价
000895	S双 汇	1,200,000	16,818,540.40	31.02	37,224,000.00	2006-6-1	待定	待定
	合计	1,200,000	16,818,540.40	31.02	37,224,000.00			

B. 截至 2006 年 12 月 31 日，本基金因处于非公开发行锁定期而流通受限的基金资产明细如下：

股票代码	股票名称	数量	投资成本	年末估值单价	年末估值总额	申购日期	可流通日期	复牌开盘单价	估值方法
600426	华鲁恒升	2,800,000	21,000,000.00	7.98	22,344,000.00	2006-11-23	2007-11-22	待定	市价
600589	广东榕泰	1,200,000	7,200,000.00	8.46	10,152,000.00	2006-11-3	2007-11-02	待定	市价
	合计	4,000,000	28,200,000.00		32,496,000.00				

C. 截至 2006 年 12 月 31 日，本基金因配股而流通受限的基金资产明细如下：

股票代码	股票名称	数量	投资成本	年末估值单价	年末估值总额	可流通日期	复牌开盘单价	估值方法
600601	方正科技	1,699,993	6,311,649.43	4.31	7,326,969.83	2007-1-4	3.99	市价

D. 截至 2006 年 12 月 31 日，本基金因网上新股申购而流通受限的基金资产明细如下：

股票代码	股票名称	申购日期	上市日期	数量（股）	总成本（元）	总市值（元）	复牌开盘单价	估值方法
601628	中国人寿	2006-12-28	2007-1-9	51,000	962,880.00	962,880.00	37.00	成本

E.截至 2006 年 12 月 31 日，本基金因网下新股申购而流通受限的基金资产明细如下：

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）	估值方法
002070	众和股份	2006-9-20	2006-10-12	2007-1-12	26,664	236,709.76	366,896.64	市价
002072	德棉股份	2006-9-22	2006-10-18	2007-1-18	93,547	303,092.28	470,541.41	市价
002073	青岛软控	2006-9-28	2006-10-18	2007-1-18	9,937	258,362.00	469,821.36	市价
002074	东源电器	2006-9-27	2006-10-18	2007-1-18	21,211	167,142.68	298,014.55	市价
002075	高新张铜	2006-10-12	2006-10-25	2007-1-25	79,689	338,678.25	752,264.16	市价
002076	雪 莱 特	2006-10-12	2006-10-25	2007-1-25	16,279	111,673.94	305,882.41	市价
002079	苏州固得	2006-11-1	2006-11-16	2007-2-16	26,780	171,124.20	274,762.80	市价
002080	中材科技	2006-11-7	2006-11-20	2007-2-26	21,965	197,245.70	428,756.80	市价
002083	孚日股份	2006-11-14	2006-11-24	2007-2-26	30,969	207,182.61	266,952.78	市价
002087	新野纺织	2006-11-21	2006-11-30	2007-3-1	188,209	976,804.71	1,151,839.08	市价
002088	鲁阳股份	2006-11-21	2006-11-30	2007-2-28	19,458	214,038.00	524,393.10	市价
002089	新 海 宜	2006-11-21	2006-11-30	2007-2-28	22,868	198,036.88	308,031.96	市价
002090	金智科技	2006-11-28	2006-12-8	2007-3-8	13,587	192,935.40	301,087.92	市价
002093	国脉科技	2006-12-6	2006-12-15	2007-3-15	12,036	121,563.60	243,969.72	市价
002094	青岛金王	2006-12-6	2006-12-15	2007-3-15	27,688	212,920.72	329,487.20	市价
002097	山河智能	2006-12-12	2006-12-22	2007-3-22	25,786	257,860.00	839,850.02	市价
002099	海翔药业	2006-12-13	2006-12-26	2007-3-26	40,828	471,971.68	651,614.88	市价
002100	天康生物	2006-12-13	2006-12-26	2007-3-26	20,205	219,426.30	383,086.80	市价
002101	广东鸿图	2006-12-20	2006-12-29	2007-3-29	17,212	196,388.92	331,847.36	市价
002102	冠福家用	2006-12-20	2006-12-29	2007-3-29	29,192	173,984.32	316,733.20	市价
601006	大秦铁路	2006-7-26	2006-8-1	2007-2-1	390,120	1,931,094.00	3,156,070.80	市价
601333	广深铁路	2006-12-18	2006-12-22	2007-3-22	591,780	2,225,092.80	4,243,062.60	市价
601628	中国人寿	2006-12-28	2007-1-9	2007-4-9	97,020	1,831,737.60	1,831,737.60	成本
601666	平煤天安	2006-11-10	2006-11-23	2007-2-26	186,748	1,523,863.68	2,001,938.56	市价
601872	招商轮船	2006-11-23	2006-12-1	2007-3-1	69,342	257,258.82	554,736.00	市价

B、本基金年末未持有流通受限的债券。

七、投资组合报告（2006 年 12 月 31 日）

（一）基金资产组合情况

截至 2006 年 12 月 31 日，汉鼎证券投资基金资产净值为 888,550,000.89 元，基金份额净值为 1.7771 元，基金份额累计净值为 1.7831 元。其资产组合情况如下：

序号	资产项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	股票	687,079,812.58	77.04
2	债券	183,488,516.80	20.57
3	银行存款及清算备付金	19,714,610.01	2.21
4	权证	0.00	0.00
5	其他资产	1,610,435.06	0.18
	合计	891,893,374.45	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

序号	分　类	市 值（元）	市值占基金资产净值比例（%）
1	A 农、林、牧、渔业	1,114,673.20	0.13
2	B 采掘业	2,001,938.56	0.23
3	C 制造业	437,168,127.16	49.20
	C0 食品、饮料	37,607,086.80	4.23
	C1 纺织、服装、皮毛	2,256,229.91	0.25
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷		
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	105,552,421.12	11.88
	C5 电子	160,605,404.24	18.07
	C6 金属、非金属	12,174,147.26	1.37
	C7 机械、设备、仪表	58,174,606.95	6.55
	C8 医药、生物制品	60,468,743.68	6.81
	C9 其他制造业	329,487.20	0.04
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业		
5	E 建筑业		
6	F 交通运输、仓储业	7,953,869.40	0.90
7	G 信息技术业	169,257,261.79	19.05
8	H 批发和零售贸易		
9	I 金融、保险业	23,034,617.60	2.59
10	J 房地产业	9,810,207.45	1.10
11	K 社会服务业		
12	L 传播与文化产业	36,739,117.42	4.13
13	M 综合类		
	合 计	687,079,812.58	77.33

（三）截止 2006 年 12 月 31 日前十名股票投资明细

序号	证券代码	证券名称	库存数量（股）	市值（元）	市值占基金净值比例（%）
1	600050	中国联通	18,100,000	84,527,000.00	9.51
2	600143	金发科技	2,032,448	83,208,421.12	9.36
3	600563	法拉电子	6,087,850	74,576,162.50	8.39
4	002007	华兰生物	2,614,385	59,817,128.80	6.73
5	600271	航天信息	1,499,200	52,486,992.00	5.91
6	002028	思源电气	1,327,753	39,155,435.97	4.41
7	000895	S双 汇	1,200,000	37,224,000.00	4.19
8	600584	长电科技	2,696,371	27,260,310.81	3.07
9	002045	广州国光	1,962,536	27,161,498.24	3.06
10	600588	用友软件	800,506	24,063,210.36	2.71

提示：投资者欲了解本报告期末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、累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%的股票明细：

(1) 报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值 2%的股票明细

序号	证券代码	证券名称	买入金额（元）	占期初基金资产净值比例（%）
1	600584	长电科技	68,238,074.74	14.92
2	600050	中国联通	59,769,014.06	13.07
3	600143	金发科技	49,050,926.11	10.72
4	000063	中兴通讯	45,545,075.74	9.96
5	600271	航天信息	41,453,639.23	9.06
6	000559	万向钱潮	31,801,204.88	6.95
7	600037	歌华有线	28,756,697.14	6.29
8	002007	华兰生物	27,594,212.81	6.03
9	002045	广州国光	27,088,511.84	5.92
10	600563	法拉电子	26,894,194.59	5.88
11	002028	思源电气	26,015,255.71	5.69
12	600601	方正科技	25,664,078.75	5.61
13	600075	新疆天业	24,457,576.22	5.35
14	000651	格力电器	23,658,090.66	5.17
15	600426	华鲁恒升	21,000,000.00	4.59
16	600191	华资实业	19,336,075.11	4.23
17	600330	天通股份	19,022,928.82	4.16
18	600832	东方明珠	18,910,176.66	4.13
19	600588	用友软件	18,456,951.01	4.03
20	000839	中信国安	14,893,717.31	3.26
21	600831	广电网络	14,842,745.07	3.24
22	002056	横店东磁	14,796,019.03	3.23
23	000729	燕京啤酒	14,672,190.52	3.21
24	600256	广汇股份	14,505,393.40	3.17
25	600016	民生银行	14,112,113.66	3.08
26	000911	南宁糖业	14,031,610.13	3.07
27	600879	火箭股份	13,948,305.73	3.05
28	000956	中原证券	13,827,730.73	3.02
29	002076	雪 莱 特	13,630,631.82	2.98
30	600383	金地集团	12,855,096.57	2.81
31	600261	浙江阳光	12,703,313.59	2.78
32	000541	佛山照明	12,184,853.91	2.66
33	601398	工商银行	11,734,920.10	2.57
34	600019	宝钢股份	11,058,355.51	2.42
35	600460	士兰微	10,901,323.58	2.38
36	600870	厦华电子	9,990,041.64	2.18
37	600220	江苏阳光	9,268,399.84	2.03
38	600631	百联股份	9,231,528.44	2.02

（2）报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%的股票明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 卖出金额（元） | 占