汉兴证券投资基金 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。

基金托管人交通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：汉兴证券投资基金

基金简称：基金汉兴

交易代码：500015

运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：1999年12月30日

报告期末基金份额总额：3,000,000,000.00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：2000年1月10日

（二）投资目标：本基金为平衡型证券投资基金，兼顾稳定收益和资本利得。即在投资于绩优型上市公司和债券的同时，兼顾成长型上市公司的投资，充分注重投资组合的流动性，从而为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全，谋求基金资产的长期稳定收益。

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；根据行业研究的成果，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

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：交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200120

法定代表人：蒋超良

信息披露负责人：张咏东

联系电话：021-68888917

传真：021-58408836

电子邮箱：zhangyd@bankcomm.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

交通银行 上海市银城中路188号交银金融大厦

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

会计期间：06年1月1日到06年12月31日

	财务指标	2006	2005	2004
1	基金本期净收益	1,188,829,909.10元	-132,550,678.34元	150,120,703.81元
2	加权平均份额基金本期净收益	0.3863元	-0.0442元	0.0500元
3	期末可供分配基金份额收益	0.2217元	-0.1746元	-0.1304元
4	期末基金资产净值	4,552,765,335.11元	2,568,726,577.83元	2,644,866,534.04元
5	期末基金份额净值	1.5176元	0.8562元	0.8816元
6	本期基金份额净值增长率	77.25%	-2.88%	-3.63%

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。

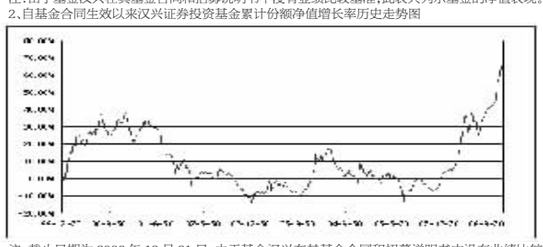
（二）基金净值表现

1、汉兴证券投资基金历史各时间段份额净值增长率表

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	23.76%	2.10%	-	-	-	-
过去六个月	26.02%	2.37%	-	-	-	-
过去一年	77.25%	2.60%	-	-	-	-
过去三年	65.89%	2.36%	-	-	-	-
过去五年	62.08%	2.18%	-	-	-	-
自基金成立起至今	73.28%	2.23%	-	-	-	-

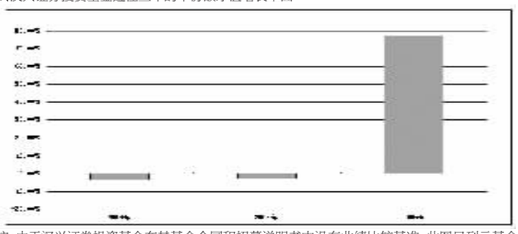
注：由于基金汉兴在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此表只列示基金的净值表现。

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12月31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。

3、汉兴证券投资基金过往三年的年份额净值增长率图



注：由于汉兴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）过往三年汉兴证券投资基金收益分配情况

过往三年本基金无收益分配。

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

许达先生，1968年出生，工商管理硕士，9年金融、证券从业经历。曾任卡斯特期货经纪公司分析员、申银万国证券研究所行业分析师。2001年2月加入富国基金管理有限公司，历任行业分析师、汉兴基金基金经理助理、汉盛基金基金经理助理、汉鼎证券投资基金基金经理。

（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，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77.25%，按照晨星排名，在53只封闭式基金中排名52，最近一年风险评价为偏低。

本基金在报告期内的业绩不尽如人意。主要由于05年底对06年宏观调控政策的理解存在一定程度的偏差，年初忽略了对房地产、有色金属和工程机械等行业的配置。下半年在银行、地产行业配置失败，主要是没有充分预测到人民币升值速度加快以及招商银行H股发行反响热烈。

（四）对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

1978年开始的改革开放、1991年开始的市场经济体制改革为中国经济注入了巨大的活力。而过去二十多年间，“婴儿潮”人口进入劳动力市场与农村人口向城市转移的大趋势，为中国经济增长提供了富余的劳动力，也成了中国经济高速增长的关键因素之一。未来几年，“人口红利”仍有望驱动中国经济继续高速增长，而更深入的政治和经济体制改革也将给予进一步的保障。因此，我们认为中国经济在取得举世瞩目成就的前提下，仍将健康高速发展。

伴随着中国经济的高速增长，一大批企业从无到有，从小到大，从大到强。这批企业已经成为国内细分行业的龙头，成为国内最具竞争力的公司，它们在国际上的竞争力也初步显现，显示出极强的生命力。随着中国资本市场的规范和发展，股票市场资源配置的重要功能也得以发挥，形成资金向优势企业流动、优势企业提供良好投资回报的良性循环。这些优势企业可以说正面临着其黄金发展时期：一方面经过十几年的发展，这些公司形成了一定的竞争力和品牌优势，随着这些公司的上市，资本市场的“广告效应”也使这些公司的品牌得到正反馈；另一方面，资本市场强大的融资功能也使这些公司相对容易地得到发展所必需的宝贵资金，形成强者愈强的局面。随着时间的推移，这些企业完全有可能成长为国际上最有竞争力的企业。

本基金的投资策略就是寻找这些优质企业进行投资，坚定地持有，享受企业快速发展所带来的丰厚回报。

对于2007年的市场，我们认为由于巨大的贸易顺差、资本项目下的不能自由流动以及较高的储蓄存款，股票价格将从比较合理向不便宜过渡，最终会形成泡沫，但泡沫应该不会在2007年出现。

我们认为以后几年的固定资产增速可能不高，工业增长很难持续增长，因此本基金在钢铁、电力、煤炭等行业方面低配。而对于消费及服务业的长期增长我们一直抱有很坚定的信心，因此在消费及服务业本基金超配。

四、托管人报告

2006年，交通银行在汉兴基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、基金托管协议，依法安全保管了基金资产，勤勉尽责地履行了基金托管人的义务，不存在损害基金持有人利益的行为。

2006年，按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、基金托管协议，本托管人对基金管理人——富国基金管理有限公司在汉兴基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值、基金份额净值和费用计算上进行了认真复核，未发现基金管理人有损害基金持有人的利益行为。

2006年，由汉兴基金管理人—— 富国基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汉兴基金的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、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（经审计）

（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	期末数	年初数
资产：		
银行存款	248,782,060.78	216,180,288.46
清算备付金	226,011,166.81	29,840,346.70
交易保证金	1,058,142.96	881,465.52
应收证券清算款	7,281,484.74	10,008,425.06
应收股利		
应收利息	6,287,626.99	5,850,400.98
应收申购款		
其他应收款	38,940,000.00	
股票投资市值	3,379,650,203.43	1,779,892,559.27
其中：股票投资成本	2,492,482,296.44	1,689,977,015.96
债券投资市值	927,597,503.10	543,221,344.80
其中：债券投资成本	927,077,288.38	540,580,679.16
权证投资市值	9,479,494.60	
其中：权证投资成本	9,402,559.18	
买入返售证券		
待摊费用		
其他资产		
资产合计	4,845,087,683.41	2,585,874,830.79
负债：		
负债及基金持有人权益		
应付证券清算款	280,084,446.65	9,140,412.12
应付赎回款		
应付赎回费		
应付管理人报酬	5,431,077.39	3,162,722.26
应付托管费	905,179.56	527,120.37
应付佣金	3,956,658.20	2,373,011.71
应付利息		
应付收益		
未交税金		
其他应付款	1,844,986.50	1,844,986.50
卖出回购证券款		
短期借款		
预提费用	100,000.00	100,000.00
其他负债		
负债合计	292,322,348.30	17,148,252.96
基金持有人权益：		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未实现利得	887,765,057.13	92,556,208.95
未分配收益	665,000,277.98	-523,829,631.12
持有人权益合计	4,552,765,335.11	2,568,726,577.83
负债与持有人权益总计	4,845,087,683.41	2,585,874,830.79

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	1,251,403,300.43	-87,051,173.21
1、股票差价收入	1,192,294,973.38	-162,504,068.61
2、债券差价收入	-2,806,431.00	5,500,974.98
3、权证差价收入	12,222,052.50	11,403,126.06
4、债券利息收入	19,152,543.35	16,997,378.78
5、存款利息收入	2,303,454.09	2,244,478.05
6、股利收入	28,219,034.09	39,292,195.11
7、买入返售证券收入		
8、其他收入	17,674.02	14,742.42
二、费用	62,573,391.33	45,499,505.13
1、基金管理人报酬	50,448,287.56	38,312,119.06
2、基金托管费	8,408,047.98	6,385,353.09
3、卖出回购证券利息支出	3,188,506.56	310,383.21
4、利息支出		
5、其他费用	528,549.23	491,649.77
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
银行电汇费	19,137.14	6,563.00
交易所回购手续费	19,802.65	1,246.77
债券帐户维护费	24,280.00	21,840.00
三、基金净收益	1,188,829,909.10	-132,550,678.34
加：未实现利得	795,208,848.18	56,410,722.13
四、基金经营业绩	1,984,038,757.28	-76,139,956.21

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	1,188,829,909.10	-132,550,678.34
加：期初基金净收益	-523,829,631.12	-391,278,952.78
加：本期损益平准金		
可供分配基金净收益	665,000,277.98	-523,829,631.12
减：本期已分配基金净收益		
减：期末未实现利得损失		
期末基金净收益	665,000,277.98	-523,829,631.12

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	2,568,726,577.83	2,644,866,534.04
二、本期经营活动：		
基金净收益	1,188,829,909.10	-132,550,678.34
未实现利得	795,208,848.18	56,410,722.13
经营活动产生的基金净值变动数	1,984,038,757.28	-76,139,956.21
三、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		
四、期末基金净值	4,552,765,335.11	2,568,726,577.83

所附附注为本会计报表的组成部分

（二）会计报表附注

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。

3、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
华泰证券有限责任公司	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

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（%）
海通证券股份有限公司	2,544,485,683.39	17.08	962,044,808.57	12.84
申银万国证券股份有限公司	2,217,560,686.84	14.89	754,032,395.54	10.07
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（%）
海通证券股份有限公司	83,281,961.50	16.03	969,342.70	0.22
申银万国证券股份有限公司	25,623,087.70	4.93	32,905,428.80	7.44
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（%）
海通证券股份有限公司	491,700,000.00	15.33		
申银万国证券股份有限公司	360,000,000.00	11.22	30,000,000.00	9.12
权证买卖	年成交金额	占全年交易金额的比例（%）	年成交金额	占全年交易比例%）
海通证券股份有限公司	4,216,790.06	18.73	3,215,229.65	28.19
申银万国证券股份有限公司				

关联方名称	2006年度			
佣金	年佣金	占全年佣金总量的比例（%）	年末余额	占应付佣金余额的比例（%）
海通证券股份有限公司	2,044,355.98	16.97	987,457.35	24.96
申银万国证券股份有限公司	1,783,807.87	14.81	906,465.72	22.91
	2005年度			
佣金	年佣金	占全年佣金总量的比例（%）	年末余额	占应付佣金余额的比例（%）
海通证券股份有限公司	775,889.39	12.82	332,811.00	14.02
申银万国证券股份有限公司	601,938.61	9.94	30,256.42	1.28

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%o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。

（3）其中海通证券的债券交易金额中包含了一笔网上申购新债的金额，共5,000,000元。

2006年5月31日，本基金作为原股东参与了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网上向原股东的定价发行，申购数量为700000股，申购价格为7.47元，特此说明。

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54930（张），申购价格为100元，特此说明。

(3)关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金于2006年度未通过银行间同业市场与关联方进行的债券（含回购）交易。

本基金于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：

A.向基金托管人交通银行股份有限公司购入银行间债券金额为人民币11,800,000.00元；

B. 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19,970,000.00元。

(4)基金管理人及托管人报酬

A.基金管理人报酬——基金管理费

a.基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。基金成立三个月后，如持有现金比例高于基金资产净值的20%，超出部分不计提管理费。计算方法如下：

H=E×1.50%/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）

b.基金管理人的管理费按日计算，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付给基金管理人。

	年初余额	本年计提	本年支付	年末余额
2006年度	3,162,722.26	50,448,287.56	48,179,932.43	5,431,077.39
2005年度	3,370,878.23	38,312,119.06	38,520,275.03	3,162,722.26

B.基金托管人报酬——基金托管费

a. 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

b. 基金托管费按日计算，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。

	年初余额	本年计提	本年支付	年末余额
2006年度	527,120.37	8,408,047.98	8,029,988.79	905,179.56
2005年度	561,813.03	6,385,353.09	6,420,045.75	527,120.37

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交通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	248,782,060.78	216,180,288.46
项目	2006年度	2005年度
银行存款产生的利息收入	1,529,586.25	912,721.02

(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	0.33%	0.33%

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海通证券股份有限公司于2006年及2005年年末持有本基金份额余额情况如下：

	2006-12-31	2005-12-31
海通证券股份有限公司	5,000,000.00	10,000,000.00
华泰证券有限责任公司	10,000,000.00	10,000,000.00

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、截止2006年12月31日，因股权分置改革流通受限的基金资产：

股票代码	股票名称	数量(股)	投资成本(元)	期末估值单价(元)	期末估值总额(元)	停牌日期(年/月/日)	复牌日期(年/月/日)	复牌开盘单价(元)
000895	S双汇	1,033,506	13,739,406.71	31.02	32,059,356.12	2006-6-1	-	-

B、截止2006年12月31日，因其他原因流通受限的基金资产：

股票名称	中签日期	上市日期	数量（股）	总成本（元）	总市值（元）	价值方法	受限原因
众和股份	2006-9-20	2007-1-12	26,664	235,709.76	366,896.64	市价	网下申购锁定期
江苏宏宝	2006-9-21	2007-1-12	51,209	198,690.92	358,463.00	市价	网下申购锁定期
穗恒股份	2006-9-22	2007-1-18	93,547	303,092.28	470,541.41	市价	网下申购锁定期
雪莱特	2006-10-12	2007-1-25	16,279	111,673.94	305,882.41	市价	网下申购锁定期
大通股份	2006-11-1	2007-2-16	65,825	348,872.50	568,720.00	市价	网下申购锁定期
太阳纸业	2006-11-3	2007-2-16	126,232	2,108,074.40	2,408,506.56	市价	网下申购锁定期
苏州固锝	2006-11-1	2007-2-16	26,780	171,124.20	274,762.80	市价	网下申购锁定期
中材科技	2006-11-7	2007-2-26	24,628	221,159.44	430,736.56	市价	网下申购锁定期
金螳螂	2006-11-6	2007-2-26	18,423	235,814.40	443,625.84	市价	网下申购锁定期
格栅新材	2006-11-7	2007-2-26	32,298	205,415.28	401,464.14	市价	网下申购锁定期
孚日股份	2006-11-14	2007-2-26	106,373	711,635.37	916,936.26	市价	网下申购锁定期
海鸥卫浴	2006-11-14	2007-2-26	36,152	292,270.56	788,107.84	市价	网下申购锁定期
万丰奥威	2006-11-15	2007-2-28	108,190	612,355.40	789,787.00	市价	网下申购锁定期
东方海洋	2006-11-14	2007-2-28	32,837	245,949.13	382,879.42	市价	网下申购锁定期
新野纺织	2006-11-21	2007-3-1	157,625	818,073.75	964,685.00	市价	网下申购锁定期
海欣股份	2006-11-21	2007-2-28	19,468	214,038.00	524,393.10	市价	网下申购锁定期
新海宜	2006-11-21	2007-2-28	22,988	198,036.88	308,031.96	市价	网下申购锁定期
金智科技	2006-11-28	2007-3-8	13,587	192,935.40	301,087.92	市价	网下申购锁定期
国脉科技	2006-12-6	2007-3-15	12,036	121,563.60	243,969.72	市价	网下申购锁定期
青岛金王	2006-12-6	2007-3-15	27,688	212,920.72	329,487.20	市价	网下申购锁定期
山河智能	2006-12-12	见以下注释	25,786	257,860.00	839,250.02	市价	网下申购锁定期
海翔药业	2006-12-13	见以下注释	40,628	471,971.68	651,614.88	市价	网下申购锁定期
大康生物	2006-12-13	见以下注释	20,205	219,426.30	393,086.80	市价	网下申购锁定期
广东鸿图	2006-12-20	见以下注释	17,212	196,388.92	331,847.36	市价	网下申购锁定期
冠福家用	2006-12-20	见以下注释	29,192	173,984.32	316,733.20	市价	网下申购锁定期
广博股份	2006-12-27	见以下注释	134,304	886,406.40	886,406.40	市价	网下申购锁定期
恒宝股份	2006-12-27	见以下注释	59,342	500,253.06	500,253.06	市价	网下申购锁定期
巨龙实业	2006-12-27	见以下注释	182,911	621,897.40	621,897.40	市价	网下申购锁定期
美宝高科	2006-12-27	见以下注释	179,301	3,586,020.00	3,586,020.00	市价	网下申购锁定期
日照港	2006-9-28	2007-1-18	255,339	1,200,093.30	1,833,334.02	市价	网下申购锁定期
大秦铁路	2006-7-26	2007-2-1	1,771,500	8,769,925.00	14,331,426.00	市价	网下申购锁定期
广深铁路	2006-12-18	见以下注释	2,972,990	11,178,442.40	21,316,338.30	市价	网下申购锁定期
龙辰实业	2006-9-28	2007-1-16	1,078,546	2,588,506.00	7,269,393.30	市价	网下申购锁定期
中国人寿	2006-12-28	2007-1-9	293,000	5,531,840.00	5,531,840.00	市价	新股未上市
中国人寿	2006-12-28	见以下注释	504,946	9,533,361.60	9,533,361.60	市价	网下申购锁定期
平煤天安	2006-11-10	2007-2-26	767,742	6,284,774.72	8,230,194.24	市价	网下申购锁定期
招商轮船	2006-11-23	2007-3-1	1,743,440	6,468,162.40	13,947,520.00	市价	网下申购锁定期
中国银行	2006-6-28	2007-1-5	707,355	2,176,653.40	3,727,780.05	市价	网下申购锁定期
万 科A	2006-12-25	2007-12-27	6,000,000	63,000,000.00	63,720,000.00	公允价	非公开发行锁定期
宁波华翔	2006-12-26	2007-12-24	3,000,000	25,650,000.00	25,920,000.00	公允价	非公开发行锁定期
华鲁恒升	2006-11-23	2007-11-22	3,000,000	22,500,000.00	23,940,000.00	公允价	非公开发行锁定期

注：该股票上市日期为网上发行股票上市日起锁定三个月后上市。

A、年末无持有流通受限的债券。

七、基金投资组合报告（2006年12月31日）

（一）基金资产组合情况

截至2006年12月31日，富国汉兴证券投资基金资产净值为4,552,765,335.11元，基金份额净值为1.5176元，基金份额累计净值为1.6876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	3,379,650,203.43	69.75
2	债券	927,597,503.10	19.15
3	银行存款及清算备付金	474,793,227.59	0.20
4	其他资产	53,567,254.69	9.80
5	权证	9,479,494.60	1.10
	合计	4,845,087,683.41	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

序号	证券板块名称	市值（元）	占基金净值(%)
1	A 农、林、牧、渔业	135,841,488.09	2.98
2	B 采掘业	129,693,799.75	2.85
3	C 制造业	1,469,975,128.97	32.29
	C0 食品、饮料	304,508,777.37	6.69
	C1 纺织、服装、皮毛	2,719,038.31	0.06
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷	54,398,086.86	1.19
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	197,909,200.99	4.35
	C5 电子	46,439,729.64	1.02
	C6 金属、非金属	458,238,214.23	10.07
	C7 机械、设备、仪表	205,875,462.78	4.52
	C8 医药、生物制品	199,056,878.53	4.37
	C99 其他制造业	829,740.26	0.02
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	58,538,610.00	1.29
5	E 建筑业	443,625.84	0.01
6	F 交通运输、仓储业	270,329,220.23	5.94
7	G 信息技术业	324,241,099.99	7.12
8	H 批发和零售贸易	231,091,549.90	5.08
9	I 金融、保险业	520,329,365.68	11.43
10	J 房地产业	85,534,479.78	1.88
11	K 社会服务业	78,984,073.00	1.73
12	L 传播与文化产业	35,240,000.00	0.77
13	M 综合类	39,407,762.20	0.87
	合 计	3,379,650,203.43	74.23

（三）报告期末前十名股票投资明细

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(%)
1	600036	招商银行	13,800,000	223,974,000.00	4.92
2	600660	福耀玻璃	14,300,307	209,642,500.62	4.60
3	600271	航天信息	4,774,719	167,162,912.19	3.67
4	600000	浦发银行	7,404,121	155,338,458.58	3.41
5	600312	平高电气	9,000,000	134,640,000.00	2.96
6	600009	上海机场	6,924,623	132,606,530.45	2.91
7	600519	贵州茅台	1,508,000	132,402,400.00	2.91
8	600298	安琪酵母	6,000,000	132,120,000.00	2.90
9	000829	赣南果业	6,000,000	128,460,000.00	2.82
10	002024	苏宁电器	2,682,939	119,337,126.72	2.62

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. 报告期内累计买入价值超过期初基金资产净值2%的股票明细

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（%）
1	600331	宏达股份	324,525,522.15	12.63
2	000063	中兴通讯	310,997,655.07	12.11
3	600019	宝钢股份	307,142,747.51	11.96
4	600050	中国联通	219,192,914.36	8.53
5	600009	上海机场	205,664,491.90	8.01
6	600016	民生银行	203,934,765.66	7.94
7	600271	航天信息	166,425,237.47	6.48
8	600036	招商银行	157,599,794.58	6.14
9	600519	贵州茅台	146,968,439.43	5.72
10	000839	中信国安	146,149,154.44	5.69
11	600075	新疆天业	145,231,494.42	5.65
12	000039	中集集团	137,632,620.76	5.36
13	600312	平高电气	132,703,250.04	5.17
14	600000	浦发银行	128,823,746.72	5.02
15	000002	万 科A	122,712,769.24	4.78
16	601398	工商银行	118,423,840.63	4.61
17	000768	西飞国际	117,319,425.64	4.57
18	600831	广电网络	116,075,891.78	4.52
19	600660	福耀玻璃	113,328,305.88	4.41
20	600017	日照港	112,955,057.44	4.40
21	002024	苏宁电器	108,318,663.18	4.22
22	600832	东方明珠	104,287,718.43	4.06
23	600360