汉盛证券投资基金 2007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。本半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8月24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
信息披露负责人：林志松
电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）
传真：021-68597799
电子邮箱：public@fullgoal.com.cn

（四）基金托管人：中国农业银行
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）登载半年度报告正文的管理人互联网网址：www.fullgoal.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、主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标

金额单位：人民币元

财务指标	2007年上半年度
1、基金本期净收益	1,323,755,534.09
2、基金份额本期净收益	0.6619
3、期末可供分配基金份额收益	0.6619
4、期末基金资产净值	5,879,100,122.65
5、期末基金份额净值	2.9396
6、本期基金份额净值增长率	63.16%

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。

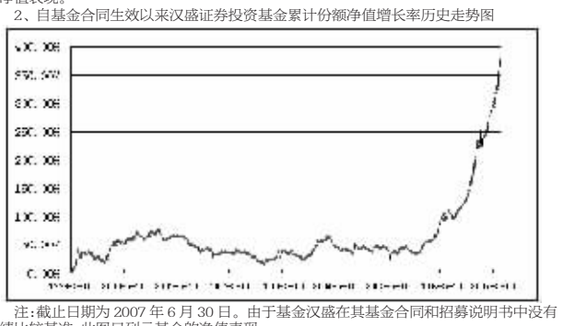
（二）基金净值表现

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
过去一个月	12.97%	2.93%	－	－	－	－
过去三个月	35.13%	2.12%	－	－	－	－
过去六个月	63.16%	3.47%	－	－	－	－
过去一年	127.62%	2.88%	－	－	－	－
过去三年	244.36%	2.67%	－	－	－	－
自基金成立起至今	375.72%	2.44%	－	－	－	－

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2007年6月30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。

三、管理人报告

（一）基金管理人及基金经理情况

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2007年6月30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、汉鼎证券投资基金三只封闭式证券投资基金和富国天源平衡混合型证券投资基金、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和富国天博创新主题股票型证券投资基金八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，自1998年开始从事证券行业工作。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，以为投资者减少和分散风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，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63.16%，按照晨星排名，报告期内本基金在26个大型股票型封闭式基金中排名第12，最近一年风险评价为低。

在宏观经济持续向好，上市公司业绩大幅超预期的背景下，股市延续了去年的走势快速上升，并经历了高位后的回落整固走势。与去年蓝筹股一枝独秀不同，在今年的行情中，市场热点发生了极大的转变，去年表现最差的低价绩差股在重组预期的带动下纷纷大幅上涨，而且涨升的幅度和速度都相当惊人。然而，在5.30印花税调控政策出台之后，绩差重组类个股经历了大幅回落的走势，投资者也经历了大喜到大悲的转化。与此同时，基金重点投资的绩优蓝筹股却扭转了前五月远落后大市的表现，股价表现持续稳定，在大市的大幅波动中显示了坚实和稳健的特性，为基金带来了低风险基础上的较好收益。在操作上，在四月初为分红进行了大规模的交易，其余时间操作力度不大。在上半年里本基金主要是进行结构调整，在二三线股大幅起落的过程中，本基金的总体投资策略没有大的变动，仍坚持对银行、地产、商业食品饮料等进行重点投资，同时加大了保险、汽车零部件等长期前景较好个股的投资。

（四）对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望下半年，在经历了持续两年、沪深300指数约五倍多的涨幅后，宏观经济过热的风险、通货膨胀、加息、QDII、大量大盘H股红筹股的回归，都为股市的上行带来较大的压力，市场将进入休整的阶段，股市可能调整的方式消化这些压力，重新聚集上涨的能量。但在宏观经济持续强劲增长、人民币持续升值、上市公司业绩持续快速增长的背景下，股市向好的大趋势并没有改变，因此，本基金在下半年的投资策略上，一方面是注重控制风险，另一方面是精选能持续增长且估值相对合理的个股进行投资。

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2007年1月1日至2007年6月30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，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8月24日

五、财务会计报告（未经审计）

（一）会计报告书

1、2007年6月30日资产负债表　　金额单位：人民币元

项　目	2007-06-30	2006-12-31
资　产：		
银行存款	668,618,112.67	337,237,644.13
清算备付金	4,515,347.25	7,598,386.65
交易保证金	660,000.00	660,000.00
应收证券清算款	171,380,933.95	
应收股利	1,607,575.32	
应收利息	19,159,375.75	5,329,752.38
应收申购款		
其他应收款	24.36	25,960,024.36
股票投资市值	4,470,423,681.42	3,190,001,555.16
其中：股票投资成本	1,910,526,469.94	1,736,675,776.97
债券投资市值	1,187,734,134.61	873,218,949.08
其中：债券投资成本	1,192,378,238.77	857,420,007.18
权证投资		11,406,983.55
其中：权证投资成本		369,055.47
买入返售证券		
待摊费用	1,306,809.08	
其他资产		
资产合计	6,525,405,994.41	4,451,413,295.31
负债及基金持有人权益		
负　债：		
应付证券清算款	106,476,112.65	323,661,511.02
应付赎回款		
应付赎回费		
应付管理人报酬	6,785,290.17	4,864,320.19
应付托管费	1,130,881.69	810,720.00
应付佣金	1,450,674.42	1,113,740.67
应付利息	121,627.41	
应付收益		
未交税金		
其他应付款	1,613,176.55	1,408,873.92
卖出回购证券款	528,500,000.00	
预提费用	228,108.87	100,000.00
其他负债		
负债合计	646,305,871.76	331,959,165.80
持有人权益：		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得	2,555,253,107.32	1,480,162,648.17
未分配收益	1,323,847,015.33	639,291,481.34
持有人权益合计	5,879,100,122.65	4,119,454,129.51
负债及基金持有人权益合计	6,525,405,994.41	4,451,413,295.31

后附附注为本会计报表的组成部分。

2、2007年上半年度经营业绩表　　金额单位：人民币元

项　目	2007年上半年度	2006年上半年度
一、收入	1,372,480,106.35	435,756,095.26
1、股票差价收入	1,316,734,270.22	391,838,064.92
2、债券差价收入	2,087,348.22	676,469.05
3、权证差价收入	21,456,526.01	16,808,971.87
4、债券利息收入	14,128,065.96	6,955,186.04
5、存款利息收入	1,613,053.97	416,047.90
6、股利收入	16,460,841.97	19,059,555.11
7、买入返售证券收入		
8、其他收入		1,800.37
二、费用	48,724,572.26	21,757,543.92
1、基金管理人报酬	36,129,946.32	17,833,220.42
2、基金托管费	6,021,657.69	2,972,203.36
3、卖出回购证券支出	5,679,640.08	700,631.03
4、利息支出		
5、其他费用	893,328.17	251,489.11
其中：上市年费	29,752.78	29,752.78
信息披露费	148,767.52	148,767.52
审计费用	49,588.57	49,588.57
三、基金净收益	1,323,755,534.09	413,998,551.34
加：本期未实现利得	1,075,090,459.15	540,039,759.54
四、基金经营业绩	2,398,845,993.24	954,038,310.88

后附附注为本会计报表的组成部分。

3、2007年上半年度收益分配表　　金额单位：人民币元

项　目	2007年上半年度	2006年上半年度
本期基金净收益	1,323,755,534.09	413,998,551.34
加：期初基金净收益	639,291,481.34	-101,779,567.03
加：以前年度损益调整		
可供分配基金净收益	1,963,047,015.43	312,218,984.31
减：本期已分配基金净收益	639,200,000.10	
期末基金净收益	1,323,847,015.33	312,218,984.31

后附附注为本会计报表的组成部分。

4、2007年上半年度净值变动表　　金额单位：人民币元

项　目	2007年上半年度	2006年上半年度
一、期初基金净值	4,119,454,129.51	1,998,767,111.44
二、本期经营活动		
基金净收益	1,323,755,534.09	413,998,551.34
未实现利得	1,075,090,459.15	540,039,759.54
经营活动产生的基金净值变动数	2,398,845,993.24	954,038,310.88
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	-639,200,000.10	
五、期末基金净值	5,879,100,122.65	2,952,805,422.32

后附附注为本会计报表的组成部分。

（二）会计报表附注

1、基金基本情况

汉盛证券投资基金(以下简称"本基金")，系经中国证券监督管理委员会证监基金字(1999)13号文《关于同意设立汉盛证券投资基金的批复》的批准，由富国基金管理有限公司、海通证券有限公司（现名为海通证券股份有限公司）、申银万国证券股份有限公司、江苏证券有限责任公司（现名为华泰证券有限责任公司）、山东国际信托投资公司、福建国际信托投资公司（现名为福建企业投资国际集团）于1999年5月10日共同发起并向社会募集设立。本基金为契约型封闭式，存续期为15年，发行规模为20亿份基金份额。本基金经上海证券交易所(以下简称上交所)上证上字[99]27号文审核同意，于1999年5月18日在上交所挂牌交易。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行。

2、财务会计报表编制基础

本基金的财务报表系按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、基金合同、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

3、主要会计政策和会计估计

（1）本半年度会计报表所采用的会计政策和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	2007年上半年度		2006年上半年度	
股票投资	年成交金额（元）	占全年交易金额的比例（%）	年成交金额（元）	占全年交易金额的比例（%）
海通证券	371,847,784.16	9.26	821,444,102.75	19.81
申银万国	400,127,029.86	9.97	781,211,580.93	18.84
债券投资	年成交金额（元）	占全年交易金额的比例（%）	年成交金额（元）	占全年交易金额的比例（%）
海通证券	114,353,467.00	27.32	58,247,982.50	23.38
申银万国			31,574,939.90	12.67
权证投资	年成交金额（元）	占全年交易金额的比例（%）	年成交金额（元）	占全年交易金额的比例（%）
海通证券			2,235,124.33	13.30
申银万国			9,479,494.47	56.39
债券回购	年成交金额（元）	占全年交易金额的比例（%）	年成交金额（元）	占全年交易金额的比例（%）
海通证券	161,200,000.00	5.86		
申银万国	18,500,000.00	0.67	450,000,000.00	45.92
佣金	2007年上半年度			
	年佣金（元）	占全年佣金总量的比例（%）	半年末余额（元）	占该应付佣金比例（%）
海通证券	300,566.68	9.29	58,358.04	4.02
申银万国	326,491.30	10.09	58,000.62	4.00
佣金	2006年上半年度			
	年佣金（元）	占全年佣金总量的比例（%）	半年末余额（元）	占该应付佣金比例（%）
海通证券	662,528.65	19.81	398,157.99	19.14
申银万国	627,849.94	18.77	392,820.05	18.88

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。

（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
2007年上半年度	4,864,320.19	36,129,946.32	34,208,976.34	6,785,290.17
2006年上半年度	2,442,201.20	17,833,220.42	16,804,376.01	3,471,045.61

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
2007年上半年度	810,720.00	6,021,657.69	5,701,496.00	1,130,881.69
2006年上半年度	407,033.49	2,972,203.36	2,800,729.27	578,507.58

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	2007-06-30	2006-06-30
银行存款余额	668,618,112.67	373,294,103.48
项目	2007年上半年度	2006年上半年度
银行存款产生的利息收入	1,548,501.07	388,322.42

（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2007年上半年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301,668,000.00元，相应的利息支出为人民币126,747.64元；

本基金2006年上半年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：

与托管行中国农业银行未进行银行间同业市场债券交易；

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338,700,000.00元，相应的利息支出为人民币107,131.71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	
	2007-06-30	2006-06-30
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持有的本基金份额余额如下：

	2007-06-30	2006-06-30
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

除此之外，本期末及上年同期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。

（6）本基金申购基金发起人华泰证券股份有限公司承销的证券情况如下：

股票代码	股票名称	中签数量(股)
601002	晋亿实业	196,335
601007	金陵饭店	106,196

5、期末流通受限的基金资产

A、截至2007年6月30日，本基金流通受限制的股票资产明细如下：

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	002124	天邦股份	2007-3-21	2007-4-3	2007-7-3	26,954	276,278.50	567,112.16	新股网下中签锁定期未上市	市价
2	002125	湘潭电化	2007-3-21	2007-4-3	2007-7-3	38,467	250,035.50	702,022.75	新股网下中签锁定期未上市	市价
3	002128	露天煤业	2007-4-10	2007-4-18	2007-7-18	45,607	446,949.60	1,628,625.97	新股网下中签锁定期未上市	市价
4	002129	中环股份	2007-4-10	2007-4-20	2007-7-20	98,899	574,603.19	1,561,615.21	新股网下中签锁定期未上市	市价
5	002130	沃尔核材	2007-4-10	2007-4-20	2007-7-20	15,964	250,954.08	788,461.96	新股网下中签锁定期未上市	市价
6	002131	利欧股份	2007-4-17	2007-4-27	2007-7-27	19,284	263,997.96	585,462.24	新股网下中签锁定期未上市	市价
7	002132	恒星科技	2007-4-17	2007-4-27	2007-7-27	44,423	355,384.00	850,700.45	新股网下中签锁定期未上市	市价
8	002133	广宇集团	2007-4-20	2007-4-27	2007-7-27	119,692	1,292,673.60	2,159,243.68	新股网下中签锁定期未上市	市价
9	002134	天津普林	2007-4-26	2007-5-16	2007-8-16	95,400	789,912.00	1,679,040.00	新股网下中签锁定期未上市	市价
10	002135	东南网架	2007-5-11	2007-5-30	2007-8-30	46,891	450,153.60	1,070,521.53	新股网下中签锁定期未上市	市价
11	002137	实益达	2007-6-4	2007-6-13	2007-9-13	25,390	261,517.00	1,216,942.70	新股网下中签锁定期未上市	市价
12	002138	顺络电子	2007-6-5	2007-6-13	2007-9-13	19,675	267,580.00	679,968.00	新股网下中签锁定期未上市	市价
13	601007	金陵饭店	2007-3-26	2007-4-6	2007-7-10	106,196	451,333.00	1,569,576.88	新股网下中签锁定期未上市	市价
14	601008	连云港	2007-4-17	2007-4-26	2007-7-26	138,007	687,274.86	2,062,164.09	新股网下中签锁定期未上市	市价
15	601919	中国远洋	2007-6-20	2007-6-26	2007-9-26	966,210	8,193,460.80	17,865,222.90	新股网下中签锁定期未上市	市价
16	600589	广东榕泰	2006-11-3		2007-11-2	4,950,000	19,800,000.00	52,173,000.00	增发新股锁定期未上市	市价
17	000002	万 科 A	2006-12-25		2007-12-27	10,500,000	73,500,000.00	136,500,000.00	非公开发行股票锁定未上市	按证监会要求
18	002048	宁波华翔	2006-12-26		2007-12-24	9,000,000	76,950,000.00	108,360,000.00	非公开发行股票锁定未上市	按证监会要求
19	600126	华鲁恒升	2006-11-23		2007-11-22	4,200,000	31,500,000.00	70,182,000.00	非公开发行股票锁定未上市	按证监会要求
20	600831	广电网络	2007-1-22		2008-1-18	2,000,000	25,960,000.00	35,840,000.00	非公开发行股票锁定未上市	按证监会要求
21	600963	岳阳纸业	2007-3-26		2008-3-25	9,000,000	99,900,000.00	132,660,000.00	非公开发行股票锁定未上市	按证监会要求

B、截至2007年6月30日，本基金流通受限制不能自由转让的债券明细如下：本基金截至2007年6月30日从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款余额528,500,000.00元(到期日2007年7月6日)，系以如下债券作为抵押：

债券代码	债券名称	回购到期日	数量（张）	成本总额（元）	期末估值总额（元）	估值方法
010211	01国开11	2007-7-6	100,000	10,409,060.00	10,409,060.00	成本
040215	04国开15	2007-7-6	500,000	51,003,380.00	51,003,380.00	成本
040217	04国开17	2007-7-6	100,000	10,084,000.00	10,084,000.00	成本
040220	04国开20	2007-7-6	100,000	10,068,000.00	10,068,000.00	成本
050408	05农发08	2007-7-6	600,000	59,724,360.00	59,724,360.00	成本
050415	05农发15	2007-7-6	500,000	49,899,550.00	49,899,550.00	成本
060202	06国开02	2007-7-6	300,000	29,970,000.00	29,970,000.00	成本
060212	06国开12	2007-7-6	100,000	10,100,000.00	10,100,000.00	成本
060229	06国开29	2007-7-6	300,000	30,033,000.00	30,033,000.00	成本
060231	06国开31	2007-7-6	500,000	50,045,000.00	50,045,000.00	成本
060301	06进出01	2007-7-6	800,000	79,631,420.00	79,631,420.00	成本
060407	06农发07	2007-7-6	200,000	20,046,000.00	20,046,000.00	成本
060417	06农发17	2007-7-6	600,000	59,970,000.00	59,970,000.00	成本
0701009	07央行票据09	2007-7-6	700,000	67,986,736.71	67,986,736.71	成本
合 计			5,400,000	538,970,506.71	538,970,506.71	

六、投资组合报告（2007年06月30日）

（一）基金资产组合情况

截至2007年6月30日，汉盛证券投资基金资产净值为5,879,100,122.65元，基金份额净值为2.9396元，基金份额累计净值为3.7422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	4,470,423,681.42	68.51
2	债　券	1,187,734,134.61	18.20
3	银行存款及清算备付金	673,133,459.92	10.32
4	其他资产	194,114,718.46	2.97
5	权　证		
6	资产支持证券		
	合　计	6,525,405,994.41	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)	市值占基金资产净值比例(%)
1	A 农、林、牧、渔业	294,624,982.00	5.01
2	B 采掘业	37,285,493.41	0.63
3	C 制造业	1,839,257,828.72	31.29
	C0 食品、饮料	287,295,392.64	4.89
	C1 纺织、服装、皮毛		
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷	135,289,930.94	2.30
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	166,952,005.35	2.84
	C5 电子	11,253,493.45	0.19
	C6 金属、非金属	622,329,486.54	10.59
	C7 机械、设备、仪表	291,217,123.02	4.95
	C8 医药、生物制品	322,056,448.58	5.48
	C9 其他制造业	2,863,948.20	0.05
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	7,749,907.00	0.13
5	E 建筑业	1,070,521.53	0.02
6	F 交通运输、仓储业	20,527,056.99	0.35
7	G 信息技术业	204,951,539.12	3.49
8	H 批发和零售贸易	208,189,321.50	3.54
9	I 金融、保险业	1,523,923,531.58	25.92
10	J 房地产业	284,549,243.68	4.84
11	K 社会服务业	1,569,576.88	0.03
12	L 传播与文化产业	35,840,000.00	0.61
13	M 综合类	10,884,679.01	0.19
	合　计	4,470,423,681.42	76.04

（三）报告期末前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量（股）	股票市值（元）	市值占基金资产净值%
1	600000	浦发银行	15,000,000	553,050,000.00	9.41
2	600036	招商银行	20,710,577	508,444,665.35	8.65
3	600660	福耀玻璃	15,500,000	477,245,000.00	8.12
4	000829	天音控股	7,899,800	270,805,144.00	4.61
5	002007	华兰生物	5,500,000	231,110,000.00	3.93
6	601318	中国平安	3,153,520	226,832,693.60	3.86
7	000895	双汇发展	3,000,000	177,660,000.00	3.02
8	600030	中信证券	2,899,910	155,174,184.10	2.64
9	000024	招商地产	3,000,000	145,890,000.00	2.48
10	000338	潍柴动力	1,709,369	139,501,604.09	2.37

注：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占期初基金资产净值比例前面20名的股票明细。

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额（元）	占期初基金资产净值的比例(%)
1	601318	中国平安	169,841,779.77	4.12
2	600030	中信证券	168,845,525.24	4.10
3	600050	中国联通	145,945,802.85	3.54
4	000338	潍柴动力	114,260,969.22	2.77
5	600963	岳阳纸业	99,900,000.00	2.43
6	600036	招商银行	88,108,915.35	2.14
7	600406	国电南瑞	85,365,587.47	2.07
8	600000	浦发银行	74,586,677.15	1.81
9	600016	民生银行	53,149,442.59	1.29
10	600058	五矿发展	50,133,456.00	1.22
11	000024	招商地产	39,964,431.08	0.97
12	600123	兰花科创	34,766,160.96	0.84
13	600693	东百集团	29,657,628.42	0.72
14	600962	国投中鲁	28,498,332.74	0.69
15	000568	泸州老窖	27,448,097.47	0.67
16	600557	康缘药业	26,143,428.46	0.63
17	601398	工商银行	26,070,432.41	0.63
18	600831	广电网络	25,960,000.00	0.63
19	600361	华联综超	20,019,685.21	0.49
20	600790	轻纺城	18,908,594.80	0.46

2. 报告期内累计卖出价值占期初基金资产净值比例前20名的股票明细。

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额（元）	占期初基金资产净值的比例(%)
1	600000	浦发银行	210,102,011.41	5.10
2	000895	双汇发展	171,386,091.97	4.16
3	600030	中信证券	169,778,650.26	4.12
4	000002	万 科 A	141,356,811.27	3.43
5	600386	*ST北巴	130,400,413.55	3.17
6	600269	赣粤高速	124,132,116.30	3.01
7	600028	中国石化	105,690,711.92	2.57
8	000829	天音控股	88,741,699.02	2.15
9	600406	国电南瑞	88,584,144.01	2.15
10	600123	兰花