

汉兴证券投资基金 二 00 六年半年度报告

报告期年份：二 00 六年

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：交通银行

送出日期：二 00 六年八月二十九日

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。

基金托管人交通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，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。

目 录

一、	基金简介	1
二、	主要财务指标和基金净值表现	2
	（一）主要财务指标.....	2
	（二）基金净值表现.....	3
三、	管理人报告	4
	（一）基金管理人及基金经理小组情况.....	4
	（二）遵规守信说明.....	4
	（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.....	4
	（四）对宏观经济、证券市场及行业走势的展望.....	5
四、	托管人报告	6
五、	财务会计报告（未经审计）	6
	（一）会计报告书.....	6
	（二）会计报表附注.....	9
六、	基金投资组合报告（2006 年 6 月 30 日）	19
	（一）基金资产组合情况.....	19
	（二）按行业分类的股票投资组合.....	19
	（三）报告期末股票投资明细.....	20
	（四）报告期内股票投资组合的重大变动.....	21
	（五）报告期末按券种分类的债券投资组合.....	23
	（六）债券投资的前五名债券明细.....	23
	（七）投资组合报告附注.....	23
七、	基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人	24
八、	重大事件揭示	25
九、	备查文件目录	27

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：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦 13、14 层
邮政编码：200001
法定代表人：陈敏
信息披露负责人：林志松
电话：95105686
传真：021-63410600
电子邮箱：public@fullgoal.com.cn
- (四) 基金托管人：交通银行
注册地址：上海市仙霞路 18 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 上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦
 13、14 层

交通银行 上海市浦东新区银城中路 188 号交银金融大厦

上海证券交易所 上海市浦东南路 528 号

(六) 注册登记机构名称：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司

注册登记机构地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦
 36 楼

二、 主要财务指标和基金净值表现

(一) 主要财务指标

会计期间：06 年 1 月 1 日到 06 年 6 月 30 日

	财务指标	2006 年上半年度
1	基金本期净收益	511,845,408.82 元
2	基金份额本期净收益	0.1706 元
3	期末可供分配基金收益	-11,984,222.30 元
4	期末可供分配基金份额收益	-0.0040 元
5	期末基金资产净值	3,612,755,967.22 元
6	期末基金份额净值	1.2043 元
7	基金加权平均净值收益率	16.96%
8	本期基金单位净值增长率	40.66%
9	基金份额累计净值增长率	37.51%

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。

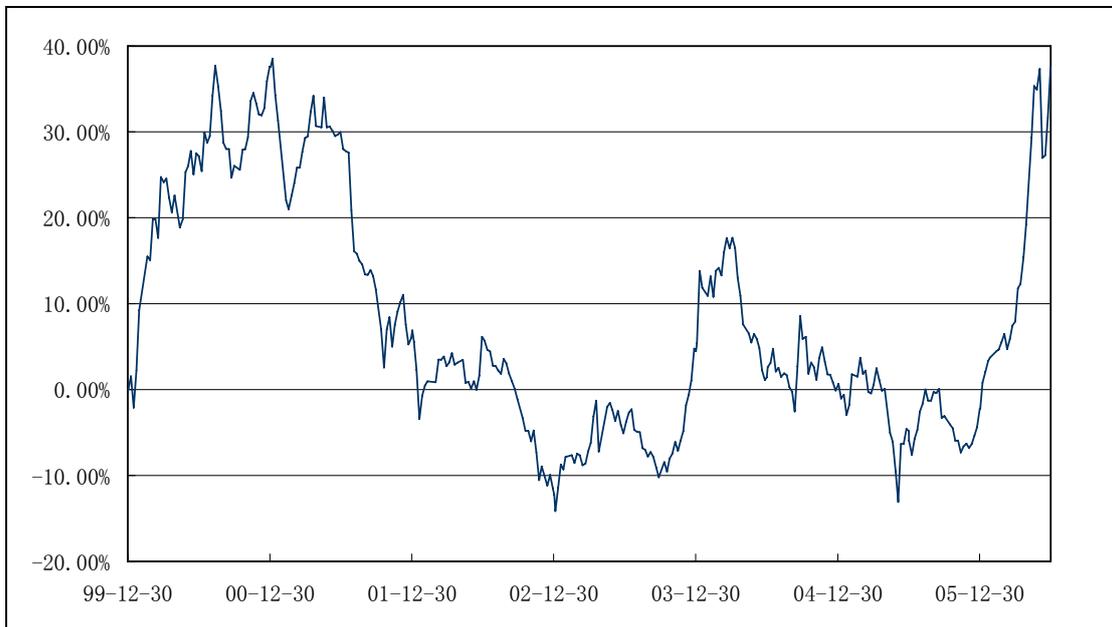
(二) 基金净值表现

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
过去一个月	1.91%	4.76%	—	—	—	—
过去三个月	27.43%	3.87%	—	—	—	—
过去六个月	40.66%	2.85%	—	—	—	—
过去一年	44.50%	2.27%	—	—	—	—
过去三年	44.90%	2.23%	—	—	—	—
过去五年	5.79%	2.17%	—	—	—	—
自基金成立起至今	37.51%	2.21%	—	—	—	—

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 6 月 30 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。

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 2005 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、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）和富国天时货币市场基金六只开放式证券投资基金。

2、基金经理小组

丁加波先生，生于 1974 年，经济学硕士，5 年证券从业经历，曾任大鹏证券投资银行部项目经理、富国基金管理公司研究部研究员、汉博基金基金经理助理、动态平衡基金基金经理助理、汉博基金基金经理。

（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 40.66%，按照晨星分类，报告期内本基金在 26 个可比股票型基金中排名第 21。在报告期内本基金实现了净值的稳定增长，但与同行比存在一定差距，我们将努力通过投资策略调整使本基金业绩下半年实

现良好表现。

汉兴基金年初对行情判断较为乐观,在大类资产配置上始终保持较高的股票仓位,操作较为成功。

行业配置方面,较为成功的对银行、食品饮料、传媒、商业、电子元器件及私有化板块进行了配置。但由于 05 年底对 06 年宏观调控政策的理解存在一定程度的偏差,认为国家宏观调控对上述行业有负面影响,因此年初忽略了对房地产、有色金属和工程机械等行业的配置。

个股选择方面,重点对一些所处行业景气度高、市场竞争地位强、未来 3 年业绩复合增长率高的公司采取买入持有的策略。

(四) 对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

对于 2006 年下半年 A 股市场我们有如下判断:

(1) 上半年宏观经济增长加速,宏观调控压力加大。

上半年 GDP 继续快速增长。固定资产投资继续加快,有过热迹象,不过投资结构得到优化;1-5 月货币供应继续加快,完成了全年规划的 70%,明显过快,CPI 和 PPI 双双走高,显示通胀压力存在。新一轮的宏观调控已经开始,调整频率频繁,但下半年总体还是谨慎的,过度的可能性较小。

(2) 下半年 A 股市场震荡将加剧,但总体偏暖。

市场经过快速上涨,整体估值水平基本合理。但资金面依然宽松,相对其他可投资市场,如地产、期货市场,股票市场依然存在较大的投资机会;另一方面,随着中国外贸继续高速增长,人民币升值压力继续增大,海外资金流入国内的速度将加快;此外,随着国家经济结构调整战略的稳步推进,一些与国家战略相符产业与上市公司将有较好的投资机会。

(3) 关注 3 大投资主题

“十一五”期间,国家经济战略将实现重大转型,与此相对应的行业与公司值得重点关注:

- 1、自主创新类公司的将迎来宽松的生存发展环境,重点看好装备制造业、通信设备和软件服务业以及具有自主创新能力的军品公司。
- 2、符合消费升级的行业或公司将稳定增长,重点关注数字电视、商贸旅游、食品饮料等行业和公司。
- 3、在美元逐渐走弱和人民币升值步伐将加快背景下,价值重估故事还将继

续，我们继续看好银行、有色金属中的锌等品种。

四、 托管人报告

2006年上半年，托管人在汉兴证券投资基金的托管过程中，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、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2006年上半年，富国基金管理有限公司在汉兴证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。基金管理人遵守了《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。

2006年上半年，由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证券投资基金的半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、 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

资 产	期末数	年初数
资产：		
银行存款	286,930,229.75	216,180,288.46
清算备付金	23,333,755.35	29,840,346.70
交易保证金	1,160,479.64	881,465.52
应收证券清算款		10,008,425.06
应收股利		
应收利息	11,179,333.98	5,850,400.98
应收申购款		
其他应收款		
股票投资市值	2,647,260,159.07	1,779,892,559.27
其中：股票投资成本	2,021,932,140.09	1,689,977,015.96
债券投资市值	738,069,197.76	543,221,344.80
其中：债券投资成本	738,657,027.22	540,580,679.16
权证投资市值	0.00	0.00

其中：权证投资成本	0.00	0.00
买入返售证券		
待摊费用		
其他资产		
资产合计	3,707,933,155.55	2,585,874,830.79
负债：		
负债及基金持有人权益		
应付证券清算款	85,225,522.42	9,140,412.12
应付赎回款		
应付赎回费		
应付管理人报酬	4,259,010.25	3,162,722.26
应付托管费	709,835.04	527,120.37
应付佣金	2,825,727.06	2,373,011.71
应付利息		
应付收益		
未交税金		
其他应付款	1,928,986.50	1,844,986.50
卖出回购证券款		
短期借款		
预提费用	228,107.06	100,000.00
其他负债		
负债合计	95,177,188.33	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	624,740,189.52	92,556,208.95
未分配收益	-11,984,222.30	-523,829,631.12
持有人权益合计	3,612,755,967.22	2,568,726,577.83
负债与持有人权益总计	3,707,933,155.55	2,585,874,830.79

所附附注为本会计报表的组成部分

2、2006 年上半年度经营业绩表

金额单位：人民币元

项 目	本期数	上年同期数
一、收入	538,734,807.18	-56,687,956.78
1、股票差价收入	497,103,441.96	-95,565,507.23
2、债券差价收入	52,952.27	-175,943.87
3、权证差价收入	11,613,502.57	
4、债券利息收入	8,432,247.34	8,802,515.90
5、存款利息收入	698,590.31	820,053.99
6、股利收入	20,816,398.71	29,416,403.26

7、买入返售证券收入		0
8、其他收入	17,674.02	14,521.17
二、费用	26,889,398.36	23,006,867.22
1、基金管理人报酬	22,369,241.52	19,243,339.22
2、基金托管费	3,728,206.92	3,207,223.15
3、卖出回购证券利息支出	544,046.98	310,383.21
4、利息支出		
5、其他费用	247,902.94	245,921.64
其中：上市年费	29,752.78	29,752.78
信息披露费	148,765.71	148,767.52
审计费用	49,588.57	49,588.57
银行电汇费	4,883.14	5,286.00
交易所回购手续费	3,462.74	1,246.77
债券帐户维护费	10,950.00	10,780.00
三、基金净收益	511,845,408.82	-79,694,824.00
加：未实现利得	532,183,980.57	-64,960,906.59
四、基金经营业绩	1,044,029,389.39	-144,655,730.59

所附附注为本会计报表的组成部分

3、2006 年上半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	511,845,408.82	-79,694,824.00
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	-11,984,222.30	-470,973,776.78
减：本期已分配基金净收益		
期末基金净收益	-11,984,222.30	-470,973,776.78

所附附注为本会计报表的组成部分

4、2006 年上半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	511,845,408.82	-79,694,824.00
未实现利得	532,183,980.57	-64,960,906.59
经营活动产生的基金净值变动数	1,044,029,389.39	-144,655,730.59

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	3,612,755,967.22	2,500,210,803.45

所附附注为本会计报表的组成部分

（二）会计报表附注

1、基金设立说明

汉兴证券投资基金(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]38号文《关于同意设立汉兴证券投资基金的批复》的批准,由海通证券股份有限公司、江苏证券有限责任公司(现名为华泰证券有限责任公司)及富国基金管理有限公司于1999年12月30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30亿份基金单位。本基金经上海证券交易所(以下简称上交所)上证上字[2000]1号文审核同意,于2000年1月10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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

2、报表编制基础

本基金的会计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》、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》及基金合同的规定而编制。

3、会计政策

(1) **会计年度:**自公历1月1日至12月31日;本会计期间为2006年1月1日至2006年6月30日

(2) **记账本位币:**人民币

(3) **记账基础和计价原则**

以权责发生制为记账基础,除股票投资、债券投资和权证按市值计价外,其余报表项目均以历史成本计价。

(4) **基金资产的估值方法**

A. 上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌交易的市场平均价估值;该日无交易的,以最近一个交易日的市场平均价计算;

B. 上市的股票的估值

送股、转增股、增发新股或配股的股票，以估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场平均价估值，该日无交易的，以最近一个交易日的市场平均价计算；

首次公开发行的股票，按其成本价估值；

- C. 上市债券以不含息价格计价，按估值日证券交易所挂牌交易的市场平均价计算后的净价估值；该日无交易的，以最近交易日净价估值，并按债券面值与票面利率在债券持有期间内逐日计提利息；
- D. 未上市债券和在银行间同业市场交易的债券以不含息价格计价，按成本估值，并按债券面值与票面利率在债券持有期间内计提利息；
- E. 上市流通的权证以其估值日在证券交易所挂牌交易的市场平均价估值；该日无交易的，以最近一个交易日的市场平均价计算；
- F. 未上市流通的权证用B-S模型等估值计数确定其公允价值，获赠权证在股权分置改革方案实施后的股票复牌日确认其获增数量；
- G. 配股权证，从配股除权日到配股确认日止，按市场平均价高于配股价的差额估值；如果市场平均价等于或低于配股价，则估值额为零；
- H. 如有确凿证据表明按上述方法对基金进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值；
- I. 如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

(5) 证券投资的成本计价方法

A. 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款入帐；因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票差价收入/（损失），出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

B. 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入帐，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入帐，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入央行票据和零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/（损失）；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/（损失）。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

C. 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资，权证投资成本按成交日应支付的全部价款入帐；

由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认权证差价收入/（损失），出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(6) 待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用是指已经发生的、影响基金单位净值小数点后第五位，应分摊计入本期和以后各期的费用；待摊费用按直线法在当期逐日摊销

(7) 收入的确认和计量

A. 股票差价收入于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

B. 债券差价收入：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于实际收到价款时确认债券差价收入，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账；

C. 权证差价收入于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

D. 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

E. 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

F. 股利收入于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

G. 买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提的金额入账；

H. 其他收入于实际收到时确认收入。

(8) 费用的确认和计量

- A. 基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提，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；
- B. 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；
- C. 卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提；
- D. 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的，则采用待摊或预提的方法。

(9) 实收基金

每份基金份额面值为 1.00 元。实收基金为对外发行的基金份额总额。

(10) 基金的收益分配政策

- A. 基金收益分配比例不低于基金净收益的90%；
- B. 基金收益分配采取现金方式，每年分配一次，分配在基金会计年度结束后的四个月内完成；
- C. 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- D. 基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
- E. 每份基金单位享有同等分配权。

(11) 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。

(12) 本报告期没有发生重大会计差错。

4、税项

A. 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]11号文《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》，自2005年1月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的2%调整为1%。

B. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

C. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55号文《关于证券投资基金税收问题的通知》，对投资者从基金分配中获得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金派发股息、红利、利息时代扣代缴20%的个人所得税，基金向个人投资者分配股息、红利、利息时，不再代扣代缴个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额。

5、会计报表重要项目注释（除另有标注外，单位均为元）

（1） 银行存款

项目	2006-6-30
活期存款	286,930,229.75

本基金2006年上半年度均未投资于定期存款。

（2） 应收利息

项目	2006-6-30
应收银行存款利息	57,161.83
应收清算备付金利息	42,666.94
应收权证保证金利息	45.63
应收债券利息	11,079,459.58
合计	11,179,333.98

（3） 投资估值增值

项目	2006上半年度		
	成本	市值	估值增值
股票投资	2,021,932,140.09	2,647,260,159.07	625,328,018.98
债券投资	738,657,027.22	738,069,197.76	-587,829.46
权证投资	0	0	0

注：2006年1月1日至2006年6月30日本基金所投资的股票中，因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价额人民币453,528.60元。此等现金对价于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

（4） 待摊费用

本报告期末无余额。

（5） 应付佣金

项目	2006-6-30
申银万国	312,384.91
海通证券	411,001.71
中建银投资	19,970.07

平安证券	615,742.89
国泰君安	269,810.57
中银国际	227,543.92
中信证券	338,748.93
银河证券	88,167.32
中金公司	260,137.55
高华证券	282,219.19
合计	2,825,727.06

(6) 其他应付款

项目	2006-6-30
深交所红利未扣税	1,522,986.50
应付券商交易保证金	250,000.00
应付券商席位使用费	156,000.00
合计	1,928,986.50

(7) 预提费用

项目	2006-6-30
审计费	49,588.57
信息披露费	148,765.71
上市年费	29,752.78
合计	228,107.06

(8) 未实现利得

项目	2006上半年度
年初余额	92,556,208.95
投资估值增/减值	532,183,980.57
其中：股票估值增值	535,412,475.67
债券估值增值	-3,228,495.10
权证估值增值	
期末余额	624,740,189.52

(9) 股票差价收入

项目	2006上半年度
卖出股票成交总额	3,553,437,699.86
减：卖出股票成本总额	3,053,339,931.99
减：应付佣金总额	2,994,325.91
股票差价收入	497,103,441.96

(10) 债券差价收入

项目	2006上半年度
卖出债券成交总额	214,131,711.56

减：卖出债券成本总额	208,165,977.54
减：应收利息总额	5,912,781.75
债券价差收入	52,952.27

(11) 其他收入

项目	2006上半年度
新股申购手续费返还	
配股手续费返还	17,674.02
其他	
合计	17,674.02

(12) 其他费用

项目	2006上半年度
审计费用	49,588.57
上市年费	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行电汇费用	4,883.14
债券账户维护费	10,950.00
回购交易费	3,462.74
其他	500.00
合计	247,902.94

(13) 本期已分配基金净收益

本基金2006上半年度未进行收益分配。

(14) 期末流通受限的基金资产

A. 截止 2006 年 6 月 30 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	双汇发展	1,033,506	13,739,406.71	31.02	32,059,356.12	2006-6-1	-	-
600775	南京熊猫	871,142	6,624,621.38	7.59	6,611,967.78	2006-6-26	2006-7-10	8.47
600823	世茂股份	10,005,489	56,164,318.86	5.32	53,229,201.48	2006-6-16	2006-8-22	4.33-

B. 截止 2006 年 6 月 30 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	可流通日	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	估值方法	受限原因
中工国际	2006-6-2	2006-6-19	2006-9-19	116,373	861,160.20	2,050,492.26	市价	网下中签锁定期
同洲电子	2006-6-9	2006-6-27	2006-9-27	34,423	550,768.00	1,403,425.71	市价	网下中签锁定

								期
云南盐化	2006-6-12	2006-6-27	2006-9-27	176,012	1,284,887.60	2,344,479.84	市价	网下中签锁定期
大同煤业	2006-6-12	2006-6-23	2006-9-25	846,469	5,722,130.44	8,693,236.63	市价	网下中签锁定期
中国银行	2006-6-28	2006-7-5	2006-7-5	2,326,000	7,164,080.00	7,164,080.00	成本价	新股未上市
中国银行	2006-6-28	见本表后注释		1,414,711	4,357,309.88	4,357,309.88	成本价	新股未上市

注：中国银行网下中签部分共 1,414,711 股中，50%锁定三个月于 06 年 10 月 9 日流通，另 50%锁定六个月于 07 年 1 月 5 日流通。

6、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 上半年度		2005 上半年度	
	上半年成交金额	占交易总金额的比例 (%)	上半年成交金额	占交易总金额的比例 (%)
股票买卖				
海通证券股份有限公司	1,081,906,535.89	15.7	180,080,536.83	6.87
申银万国证券股份有限公司	787,255,171.12	11.43	368,136,224.25	14.04
债券买卖				
海通证券股份有限公司	25,290,651.80	9.06		
申银万国证券股份有限公司	20,633,087.70	7.39	32,905,428.80	13.32
证券回购				
海通证券股份有限公司				
申银万国证券股份有限公司			30,000,000.00	9.12
权证买卖				
	上半年成交金额	占交易总金额的比例 (%)	上半年成交金额	占交易总金额的比例 (%)

海通证券股份有限公司	4,216,790.06	36.31		
申银万国证券股份有限公司				

关联方名称	2006 年上半年度				
	佣金	佣金	占佣金总额的比例 (%)	期末余额	占佣金总额的比例 (%)
海通证券股份有限公司		872,707.85	15.62	411,001.71	14.55
申银万国证券股份有限公司		636,142.79	11.39	312,384.91	11.06
关联方名称	2005 年上半年度				
	佣金	佣金	占佣金总额的比例 (%)	期末余额	占佣金总额的比例 (%)
海通证券股份有限公司		145,627.17	6.88	54,598.42	4.61
申银万国证券股份有限公司		292,907.17	13.85	134,393.33	11.35

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。

(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年上半年度和2005年上半年度均未通过银行间同业市场与关联方进行债券（含回购）交易。

(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：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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	上半年度计提	上半年度支付	期末余额
2006 上半年度	3,162,722.26	22,369,241.52	21,272,953.53	4,259,010.25
2005 上半年度	3,370,878.23	19,243,339.22	19,603,861.47	3,010,355.98

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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	上半年度计提	上半年度支付	期末余额
2006 上半年度	527,120.37	3,728,206.92	3,545,492.25	709,835.04
2005 上半年度	561,813.03	3,207,223.15	3,267,310.19	501,725.99

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	2006-6-30	2005-6-30
银行存款余额	286,930,229.75	51,920,444.67
项目	2006上半年度	2005上半年度
银行存款产生的利息收入	401,656.95	457,789.48

(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上半年度	2005上半年度
年初持有基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
加：上半年增加	-	-
减：上半年减少	-	-
期末持有基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
占期末基金总份额的比例	0.33%	0.33%

B. 基金各关联方及主要股东的控制机构所持有的本基金份额

本管理人的主要股东海通证券股份有限公司于2005年及2006上半年度末持有本基金份额余额情况如下：

	2006-6-30	2005-6-30
--	-----------	-----------

海通证券股份有限公司	10,000,000.00	10,000,000.00
------------	---------------	---------------

除此之外，2005年上半年度及2006年上半年度本基金其他关联方及其主要股东的控制机构均未持有本基金份额。

7、或有事项

无需要说明的重大或有事项。

8、承诺事项

无需要说明的承诺事项。

9、资产负债表日后的非调整事项

无需要说明的资产负债表日后的非调整事项。

10、其他重要事项

无需要说明的其他重要事项。

六、基金投资组合报告（2006年6月30日）

（一）基金资产组合情况

截至 2006 年 6 月 30 日，富国汉兴证券投资基金资产净值为 3,612,755,967.22 元，基金份额净值为 1.2043 元，基金份额累计净值为 1.3743 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	2,647,260,159.07	71.39
2	债券	738,069,197.76	19.91
3	权证		
4	银行存款及清算备付金	310,263,985.10	8.37
5	其他资产	12,339,813.62	0.33
	合计	3,707,933,155.55	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	107,849,368.60	2.99
2	B 采掘业	121,913,236.63	3.37
3	C 制造业	1,273,192,432.38	35.24
	C0 食品、饮料	171,455,905.49	4.75

	C1 纺织、服装、皮毛	149,500,000.00	4.14
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷		
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	232,762,255.78	6.44
	C5 电子	141,376,000.00	3.91
	C6 金属、非金属	148,902,675.36	4.12
	C7 机械、设备、仪表	277,618,477.57	7.68
	C8 医药、生物制品	151,577,118.18	4.20
	C99 其他制造业		
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	98,702,836.92	2.73
5	E 建筑业		
6	F 交通运输、仓储业	75,854,000.00	2.10
7	G 信息技术业	142,939,054.69	3.96
8	H 批发和零售贸易	298,668,450.63	8.27
9	I 金融、保险业	187,141,389.88	5.18
10	J 房地产业	66,080,000.00	1.83
11	K 社会服务业	97,275,389.34	2.69
12	L 传播与文化产业	95,004,000.00	2.63
13	M 综合类	82,640,000.00	2.29
	合计	2,647,260,159.07	73.28

(三) 报告期末股票投资明细

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	600312	G 平 高	14,200,000	169,122,000.00	4.68
2	600331	G 宏 达	9,000,074	152,731,255.78	4.23
3	600220	G 苏阳光	26,000,000	149,500,000.00	4.14
4	600036	G 招 行	17,000,000	131,920,000.00	3.65
5	600028	中国石化	18,000,000	113,220,000.00	3.13
6	600075	G 天 业	8,000,695	107,849,368.60	2.99
7	600628	G 新世界	12,000,000	105,480,000.00	2.92
8	600649	G 原 水	17,500,503	98,702,836.92	2.73
9	000839	G 国 安	5,000,000	97,600,000.00	2.70
10	600360	G 华 徽	8,200,000	97,006,000.00	2.69
11	600831	G 广 电	5,800,000	95,004,000.00	2.63
12	600832	G 明 珠	8,000,000	82,640,000.00	2.29
13	600327	大厦股份	10,000,000	82,500,000.00	2.28
14	600298	G 安 琪	5,900,077	81,952,069.53	2.27
15	600260	G 凯 乐	11,100,000	80,031,000.00	2.22
16	002048	宁波华翔	4,300,574	77,582,354.96	2.15

17	600436	G 片仔癀	4,000,000	73,520,000.00	2.04
18	000612	焦作万方	9,100,395	67,888,946.70	1.88
19	000402	G 金融街	8,000,000	66,080,000.00	1.83
20	600305	G 恒 顺	5,000,000	55,100,000.00	1.53
21	600823	世茂股份	10,005,489	53,229,201.48	1.47
22	000978	G 桂 旅	5,800,219	52,317,975.38	1.45
23	600196	G 复 星	7,000,000	46,900,000.00	1.30
24	600563	G 法 拉	4,500,000	44,370,000.00	1.23
25	600016	G 民 生	10,000,000	43,700,000.00	1.21
26	600830	大 红 鹰	8,623,065	42,339,249.15	1.17
27	000063	G 中 兴	1,300,476	37,323,661.20	1.03
28	000039	G 中集	2,000,658	32,350,639.86	0.90
29	000895	双汇发展	1,033,506	32,059,356.12	0.89
30	600449	赛马实业	4,700,468	31,023,088.80	0.86
31	600590	G 泰 豪	3,223,579	30,914,122.61	0.86
32	000088	G 盐田港	3,000,000	27,330,000.00	0.76
33	002038	双鹭药业	1,800,000	25,776,000.00	0.71
34	600717	G 天津港	3,000,000	25,200,000.00	0.70
35	600269	G 赣 粤	2,380,000	23,324,000.00	0.65
36	000888	G 峨眉山	3,184,230	21,620,921.70	0.60
37	000428	G 华 天	2,900,000	21,286,000.00	0.59
38	600019	G 宝 钢	4,000,000	17,640,000.00	0.49
39	600729	G 重 百	1,500,000	15,120,000.00	0.42
40	601988	中国银行	3,740,711	11,521,389.88	0.32
41	601001	大同煤业	846,469	8,693,236.63	0.24
42	600775	南京熊猫	871,142	6,611,967.78	0.18
43	600557	G 康 缘	756,838	5,381,118.18	0.15
44	002053	云南盐化	176,012	2,344,479.84	0.06
45	002051	中工国际	116,373	2,050,492.26	0.06
46	002052	同洲电子	34,423	1,403,425.71	0.04

(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	600016	G 民 生	203,934,765.66	7.94
2	600050	G 联 通	171,902,351.70	6.69
3	600331	G 宏 达	151,545,760.09	5.90
4	600036	G 招 行	144,517,282.58	5.63
5	600019	G 宝 钢	142,395,207.22	5.54
6	600075	G 天 业	126,440,563.12	4.92

7	000839	G 国 安	117,872,607.58	4.59
8	600831	G 广 电	96,935,750.58	3.77
9	600009	G 沪机场	81,196,140.87	3.16
10	600717	G 天津港	75,427,240.22	2.94
11	600312	G 平 高	72,111,005.29	2.81
12	600011	G 华 能	69,658,395.54	2.71
13	600298	G 安 琪	65,015,233.84	2.53
14	600196	G 复 星	62,669,086.36	2.44
15	600649	G 原 水	62,167,211.96	2.42
16	000612	焦作万方	60,976,377.43	2.37
17	600260	G 凯 乐	60,745,242.68	2.36
18	600219	G 南 山	60,362,930.10	2.35
19	000002	G 万科A	59,712,769.24	2.32
20	600460	G 士兰微	59,585,745.19	2.32
21	600220	G 苏阳光	59,312,952.48	2.31
22	600256	G 广 汇	57,739,867.37	2.25
23	600436	G 片仔癀	57,575,421.32	2.24
24	600823	世茂股份	56,164,318.86	2.19
25	000063	G 中 兴	55,369,113.90	2.16
26	000978	G 桂 旅	55,246,934.25	2.15
27	002048	宁波华翔	51,799,052.05	2.02

2. 报告期内累计卖出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	累计卖出金额（元）	占期初基金资产净值比例（%）
1	600050	G 联 通	336,470,710.49	13.10
2	600016	G 民 生	188,883,873.31	7.35
3	600036	G 招 行	124,687,190.14	4.85
4	600019	G 宝 钢	121,471,528.25	4.73
5	600009	G 沪机场	93,318,587.58	3.63
6	600220	G 苏阳光	90,849,373.30	3.54
7	000956	中原油气	85,649,110.58	3.33
8	600219	G 南 山	76,522,280.15	2.98
9	600832	G 明 珠	75,247,280.26	2.93
10	600296	兰州铝业	74,807,773.96	2.91
11	600256	G 广 汇	73,282,515.90	2.85
12	600002	齐鲁石化	73,118,532.39	2.85
13	000895	双汇发展	72,480,264.16	2.82
14	000866	扬子石化	72,043,440.54	2.80
15	600011	G 华 能	69,190,527.45	2.69
16	000063	G 中 兴	68,365,931.83	2.66
17	600075	G 天 业	67,880,678.68	2.64

18	000839	G 国 安	67,560,220.82	2.63
19	600028	中国石化	64,243,504.22	2.50
20	600900	G 长 电	61,183,447.25	2.38
21	600584	G 苏长电	58,756,233.22	2.29
22	600029	南方航空	57,492,889.41	2.24
23	000662	G 索芙特	56,864,198.42	2.21
24	600717	G 天津港	56,590,237.54	2.20
25	600628	G 新世界	54,985,791.42	2.14
26	600460	G 士兰微	54,783,663.43	2.13
27	000002	G 万科A	52,869,715.79	2.06
28	000930	G 丰 原	52,778,817.63	2.05

3. 整个报告期内买入股票的成本总额为 3,385,748,584.72 元,其中未包括因股权分置改革而获得的现金对价 453,528.60 元; 卖出股票的收入总额 3,553,437,699.86 元。

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	券种	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债	387,151,067.1	10.72
2	金融债	345,918,130.66	9.57
3	可转债		
4	企业债	5,000,000.00	0.14
	合计	738,069,197.76	20.43

(六) 债券投资的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	20 国债(10)	115,284,535.60	3.19
2	05 农发 15	109,945,000.00	3.04
3	02 国债(14)	108,442,800.00	3.00
4	99 国债(8)	84,019,405.80	2.33
5	21 国债(15)	64,276,565.60	1.78

(七) 投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查

或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2、报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

3、截至 2006 年 6 月 30 日，本基金的其他资产构成如下：

其他资产项目	金 额（元）
交易保证金	1,160,479.64
应收利息	11,179,333.98
应收证券交易清算款	
待摊费用	
合计	12,339,813.62

4、截至 2006 年 6 月 30 日，本基金没有持有处于转股期的可转债

5、截止 2006 年 6 月 30 日，本基金持有权证情况：无

本基金本报告期内因股权分置改革曾持有权证的情况如下：

标的证券	权证代码	权证名称	持有原因	持有数量	成本总额	期末持有数量
G 沪机场	580996	沪场 JTP1	被动持有	2,400,525	0.00	0
G 招行	580997	招行 CMP1	被动持有	7,926,163	0.00	0
G 原水	580994	原水 CTP1	被动持有	2,500,000	0.00	0

七、 基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

1、基金份额持有人户数、持有人结构

基金份额持有人户数	平均每户持有基金份额	机构投资者持有的基金份额	机构投资者持有的基金份额比例	个人投资者持有的基金份额	个人投资者持有的基金份额比例
94,223	31,839.36	1,033,837,791	34.46%	1,966,162,209	65.54%

2、基金前十名持有人情况（封闭式）

序号	持有人	持有份额	持有份额占总份额比例(%)
1	中国人寿保险（集团）公司	276,269,751.00	9.21
2	中国人寿保险股份有限公司	273,498,842.00	9.12
3	中国太平洋保险公司	106,214,710.00	3.54
4	中国人民财产保险股份有限公司	88,437,601.00	2.95
5	中国高新投资集团公司	79,960,543.00	2.67
6	中国平安人寿保险股份有限公司	49,999,989.00	1.67

7	山东陆和电信软件有限公司	23,000,000.00	0.77
8	天安保险股份有限公司	12,540,180.00	0.42
9	海通证券股份有限公司	10,000,000.00	0.33
10	富国基金管理有限公司	10,000,000.00	0.33
11	华泰证券有限责任公司	10,000,000.00	0.33

八、重大事件揭示

- 1、本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。
- 2、本报告期本基金管理人未发生重大人事变动。
- 3、2006年1月25日，本基金托管人交通银行股份有限公司在《证券时报》、《金融时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于阮红基金托管行业高管任职资格的公告》。2006年7月18日，交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于住所变更的公告》。交通银行股份有限公司住所由“上海市仙霞路18号”变更为“上海市浦东新区银城中路188号”。
- 4、本报告期内，无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。
- 5、本报告期本基金投资策略无改变。
- 6、本报告期内本基金无收益分配事项。
- 7、本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。
- 8、本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。
- 9、截止2006年6月30日各券商股票、债券、回购交易量及佣金情况如下：

交易席位	成交量（人民币元）				佣金 （人民币元）
	股票	债券	回购	权证	
申万	787,255,171.12	20,633,087.70			636,142.79
海通	1,081,906,535.89	25,290,651.80	0	4,216,790.06	872,707.85
中国建银 投资证券	346,811,931.41	15,635,640.00	0	0	284,227.93
平安证券	1,220,629,485.43	18,676,999.10	20,000,000.00	0	981,468.49
招商证券	129,513,930.53	12,004,603.40	0	0	103,857.10
国泰君安	510,129,021.82	19,895,977.30	74,000,000.00	0	410,615.00
中银国际	763,191,068.48	39,473,492.90	0	0	625,413.30
长城证券	98,288,363.14	2,204,675.00	0	0	79,068.38
中信证券	711,242,438.09	64,765,478.20	476,000,000.00	7,397,613.13	577,796.97
银河证券	337,981,730.96	12,049,200.00	0	0	274,521.30
中金公司	559,076,449.27	20,046,695.50	0	0	458,235.60
高华证券	344,527,779.56	28,537,202.90	0	0	282,219.19

合计	6,890,553,905.70	279,213,703.80	570,000,000.00	11,614,403.19	5,586,273.90
----	------------------	----------------	----------------	---------------	--------------

交易席位	成交量占比				佣金占总 佣金比例 (%)
	股票交易量占股票总 交易量的比例(%)	债券交易量占债券总 交易量的比例(%)	回购交易量占回购总 交易量的比例(%)	权证交易量占权证 总交易量比例(%)	
申万	11.43	7.39			11.39
海通	15.70	9.06		36.31	15.62
中国建银投 资证券	5.03	5.60			5.09
平安证券	17.71	6.69	3.51		17.57
招商证券	1.88	4.30			1.86
国泰君安	7.40	7.13	12.98		7.35
中银国际	11.08	14.14			11.20
长城证券	1.43	0.79			1.42
中信证券	10.32	23.20	83.51	63.69	10.34
银河证券	4.91	4.32			4.91
中金公司	8.11	7.18			8.20
高华证券	5.00	10.22			5.05
金元证券					
合计	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00

注：上述佣金不包括上海及深圳证券交易所收取的证券结算风险基金。

10、(1) 本期各券商租用席位情况：

券商名称	2006 上半年度席位
申万	2
海通	2
中国建银投资证券	1
平安证券	2
招商证券	2
国泰君安	2
中银国际	1
长城证券	2
中信证券	1
银河证券	2
中金公司	1
高华证券	1
金元证券	1

(2) 本期各券商租用席位变更情况如下：

本报告期内，基金汉兴终止的证券公司席位有西南证券和招商证券；南方证券在本报告期内关闭，由中国建银投资证券接收，本基金沿用原来席位。本报告期内，本基金新增了高华证券席位。

我对基金交易席位的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

11、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号码的公告》，开通全国统一客户服务号码 95105686（免长途话费）。

九、 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立汉兴基金的文件
- 2、汉兴证券投资基金基金合同
- 3、汉兴证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、汉兴证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

存放地点：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦 13、14 层

查阅方式：投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话：95105686

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

富国基金管理有限公司

二 00 六年八月二十九日