

汉盛证券投资基金 2007 年第 2 季度报告

一、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。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于 2007 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金季度财务报告未经审计。

二、基金产品概况

基金简称：基金汉盛

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

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。

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行

三、主要财务指标和基金净值表现

(一) 主要财务指标 单位：人民币元

1、基金本期净收益	667,500,839.17
2、基金份额本期净收益	0.3338
3、期末基金资产净值	5,879,100,122.65
4、期末基金份额净值	2.9396

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

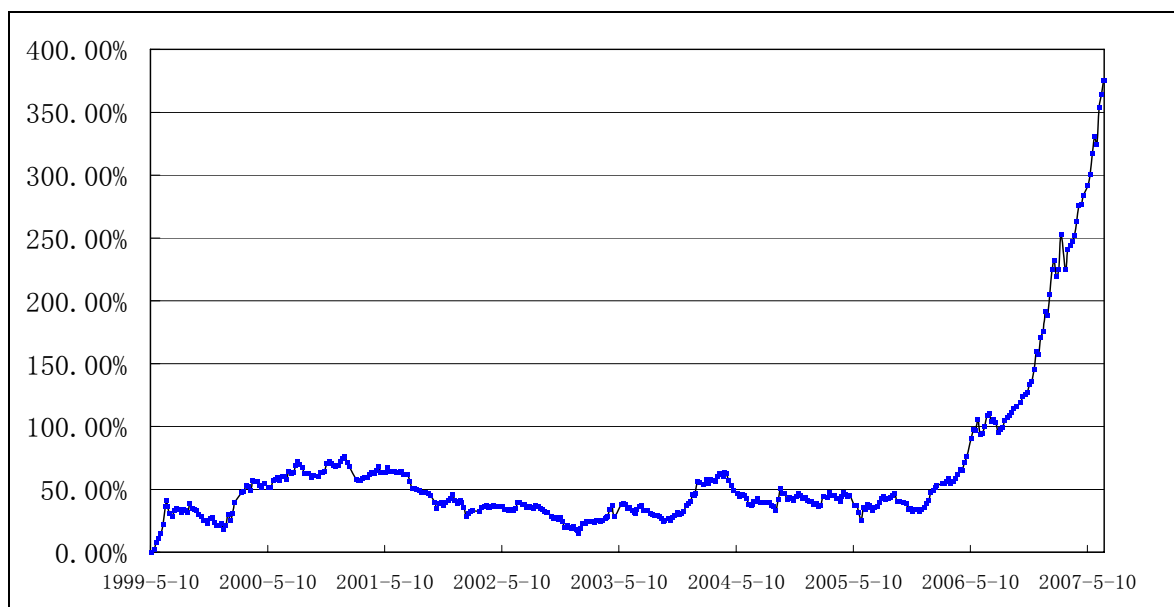
1、汉盛证券投资基金本期份额净值增长率表

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	35.13%	2.12%	—	—	—	—

注：过去三个月指 2007 年 4 月 1 日-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的历史走势

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。

四、管理人报告

(一) 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） 运作情况说明

在宏观经济持续向好，上市公司第一季报业绩大幅超预期的背景下，股市延续了前期的走势快速上升，并经历了高位后的快速回落走势。在今年二季度的行情中，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。在二季度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。

展望第三季度，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，股市将以横向或向下调整的方式消化这些压力，重新聚集上涨的能量。因此，本基金在第三季度的投资策略上，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。

五、投资组合报告（未经审计）

（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		
	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) 股票投资的前十名股票明细

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	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

(四) 债券投资组合

序号	债券名称	市值 (元)	市值占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	598,864,077.90	10.19
2	金融债券	520,883,320.00	8.86
3	可转换债券		
4	央行票据	67,986,736.71	1.15
	合 计	1,187,734,134.61	20.20

(五) 投资的前五名债券明细

序号	证券名称	市值 (元)	市值占基金资产净值比例 (%)
1	20 国债 10	122,021,303.40	2.08
2	02 国债 14	118,935,430.20	2.02
3	05 农发 15	99,799,100.00	1.70
4	21 国债 15	98,454,570.50	1.67
5	21 国债 3	90,851,424.30	1.55

(六) 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 2007 年 6 月 30 日，本基金的其他资产构成如下：

名 称	金 额 (元)
应收利息	19,159,375.75
应收股利	1,607,575.32
其他应收款	500,024.36
交易保证金	160,000.00
应收证券清算款	171,380,933.95
待摊费用	1,306,809.08
合 计	194,114,718.46

4、截至 2007 年 6 月 30 日，本基金不持有处于转股期的可转债。

5、本基金本报告期内及本报告期末均不持有资产支持证券。

6、截止 2007 年 6 月 30 日，本基金不持有权证。

本基金本报告期内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 (份)	成本总额 (元)	期末数量 (份)
武钢股份	580013	武钢 CWB1	买入可分离转债	4,498,472	11,045,998.00	0

六、本公司固有资金持有本基金的份额及变化情况

截至 2007 年 6 月 30 日，本公司持有本基金的份额为 10,000,000.00 份，本报告期持有份额没有变化。

七、备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立汉盛基金的文件
- 2、汉盛证券投资基金基金合同
- 3、汉盛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、汉盛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

查阅地点：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5 层

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、4008880688（全国统一，免长途话费）

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

富国基金管理有限公司
二 00 七年七月十九日