

# 汉鼎证券投资基金 2006 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。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于 2006 年 7 月 19 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：基金汉鼎

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

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。

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行

### 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	52,541,354.92
2	加权平均基金份额本期净收益	0.1051
3	期末基金资产净值	694,984,837.55
4	期末基金份额净值	1.3900

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。

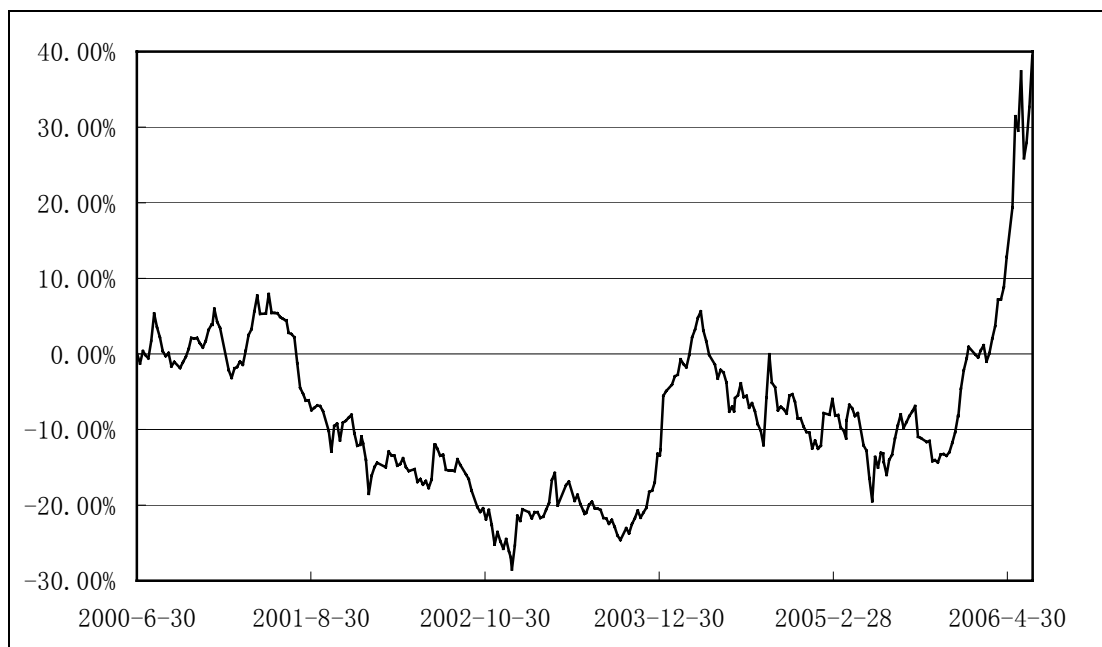
(二)、基金净值表现

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	34.48%	4.60%	—	—	—	—

注：过去三个月指 2006 年 4 月 1 日—2006 年 6 月 30 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，此表只列示基金的净值表现。

2、自基金合同生效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 6 月 30 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。

## 四、管理人报告

### （一）、基金管理小组

许达先生，1968年出生，工商管理硕士，8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。

### （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《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《汉鼎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，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

### （三）、运作情况说明

宏观经济预期仍然向好，投资环境迅速改善，投资信心迅速恢复。二季度本基金仍延续了一季度相对激进的投资策略，在大类资产配置上对股票投资的比例一直接近 80% 的上限比例。在风格资产的配置上，仍然是小盘成长股的比例较大，大盘价值股的比例较小。在股票选择上，投资重点仍然是有核心竞争优势的高科技公司。对于重点配置的 IT 类上市公司基本符合以下特征：科研投入大，研发支出占其主营业务收入的 5% 以上；市场份额高，而且市场占有率有扩大的趋势。值得说明的是，由于 G 中兴的年报及预期中的一季报及半年报远低于预期，本基金在二季度进行了减持。G 苏长电亦应属于科技创新型企业，其拥有自主知识产权的新产品即将进入大规模应用，预期良好，本基金在二季度进行了增持。二季度本基金收益率为 34.48%，基本符合预期。

## 五、投资组合报告（未经审计）

### （一）基金资产组合情况

截至 2006 年 6 月 30 日，汉鼎证券投资基金资产净值为 694,984,837.55 元，基金份额净值为 1.3900 元，基金份额累计净值为 1.3960 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	546,813,128.01	70.82
2	债券	142,792,418.40	18.49
3	银行存款及清算备付金	76,578,452.05	9.92
4	权证		
5	其他资产	5,878,545.35	0.76
	合计	772,062,543.81	100

## (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	10,853,664.64	1.56
2	B 采掘业		
3	C 制造业	435,009,044.77	62.59
	C0 食品、饮料	52,395,027.60	7.54
	C1 纺织、服装、皮毛	61,221,020.50	8.81
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷		
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	43,418,964.60	6.25
	C5 电子	158,601,569.50	22.82
	C6 金属、非金属		
	C7 机械、设备、仪表	78,708,395.67	11.33
	C8 医药、生物制品	40,664,066.90	5.85
	C9 其他制造业		
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	G 信息技术业	91,170,521.02	13.12
8	H 批发和零售贸易	6,672,440.16	0.96
9	I 金融、保险业	2,423,960.00	0.35
10	J 房地产业		
11	K 社会服务业	683,497.42	0.10
12	L 传播与文化产业		
13	M 综合类		
	合 计	546,813,128.01	78.68

## (三) 股票投资的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量 (股)	期末市值 (元)	市值占基金资产净值比例 (%)
1	600220	G 苏阳光	10,647,134.00	61,221,020.50	8.81
2	600563	G 法 拉	5,958,249.00	58,748,335.14	8.45
3	600584	G 苏长电	6,686,194.00	54,425,619.16	7.83

4	600050	G 联 通	20,502,400.00	50,025,856.00	7.20
5	600143	G 金 发	2,192,877.00	43,418,964.60	6.25
6	002007	华兰生物	1,830,890.00	40,664,066.90	5.85
7	600588	G 用 友	1,947,083.00	40,187,793.12	5.78
8	000895	双汇发展	1,200,000.00	37,224,000.00	5.36
9	002028	思源电气	1,327,753.00	28,878,627.75	4.16
10	000559	G 钱 潮	7,459,848.00	26,407,861.92	3.80

(四) 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	120,802,418.40	17.38
2	企业债券	2,000,000.00	0.29
3	金融债	19,990,000.00	2.88
4	可转债		
	合计	142,792,418.40	20.55

(五) 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)	32,209,538.40	4.63
2	00 国债 07	30,264,000.00	4.35
3	02 国债(14)	26,106,600.00	3.76
4	05 农发 15	19,990,000.00	2.88
5	99 国债(8)	18,558,240.00	2.67

(六) 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，本基金的其他资产项目包括：

序号	其他资产项目	金额(元)
1	交易保证金	352,851.83
2	应收利息	2,654,855.62
3	应收证券交易清算款	2,870,837.90
4	其他应收款	
5	应收申购款	
	其他资产项目合计	5,878,545.35

4、截至 2006 年 6 月 30 日，本基金不持有处于转股期的可转债。

5、截止 2006 年 6 月 30 日，本基金未持有权证及本基金本报告期内因股权分置改革未曾持有权证。

## 六、本公司固有资金持有本基金的份额及变化情况

截至 2006 年 6 月 30 日，本公司持有本基金的份额为 1,250,000.00 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鼎基金的文件
- 2、汉鼎证券投资基金基金合同
- 3、汉鼎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、汉鼎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：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦 13、14 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

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

富国基金管理有限公司

二 00 六年七月二十一日