

汉博证券投资基金 二 00 五年半年度报告

报告期年份：二 00 五年

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二 00 五年八月二十五日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2005 年 8 月 22 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。

基金半年度财务报告未经审计。

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	5
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	8
六、投资组合报告 (2005 年 6 月 30 日)	17
(一) 基金资产组合情况	17
(二) 按行业分类的股票投资组合	18
(三) 报告期末股票投资明细	18
(四) 报告期内股票投资组合的重大变动	19
(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合	21
(六) 报告期末债券投资的前五名债券明细	22
(七) 投资组合报告附注	22
七、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人	22
八、重大事件揭示	23
九、备查文件目录	24

一、基金简介

(一) 基金名称：汉博证券投资基金

基金简称：基金汉博

交易代码：500035

运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2000 年 7 月 12 日

报告期末基金份额总额：500,000,000.00 份

基金合同存续期：至 2007 年 5 月 29 日

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 10 月 17 日

(二) 投资目标：投资于具有良好成长性，符合产业发展潮流，对未来经济发展有重要推动作用的新兴产业类上市公司，从而实现长期资本增值，同时充分注重投资组合的成长性并兼顾流动性，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：组合相对分散，重仓品种谨慎选择，操作频率适度快捷；积极投资新兴产业类个股，同时适当挖掘一些价值被低估或产业转型成为成功的股票进行投资；积极参与新股申购，提高资金的使用效率。

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：021-53594678

传真：021-63410600

电子邮箱：public@fullgoal.com.cn

(四) 基金托管人：中国建设银行股份有限公司（简称“中国建设银行”）

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

邮政编码：100032
法定代表人：郭树清
信息管理负责人：尹 东
联系电话：010-67597420
传真：010-66212638
电子邮箱：yindong@ccb.cn

- (五) 本基金选用的信息披露报刊：中国证券报、上海证券报
登载半年度报告正文的互联网网址：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
中国建设银行 北京市西城区金融大街 25 号
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
注册登记机构办公地址：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

1、基金本期净收益	-16,893,931.21 元
2、基金份额本期净收益	-0.0338 元
3、期末可供分配基金收益	-58,446,195.99 元
4、期末可供分配基金份额收益	-0.1169 元
5、期末基金资产净值	441,553,804.01 元
6、期末基金份额净值	0.8831 元
7、基金加权平均净值收益率	-3.75%
8、本期基金份额净值增长率	-3.56%
9、基金份额累计净值增长率	-5.95%

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。

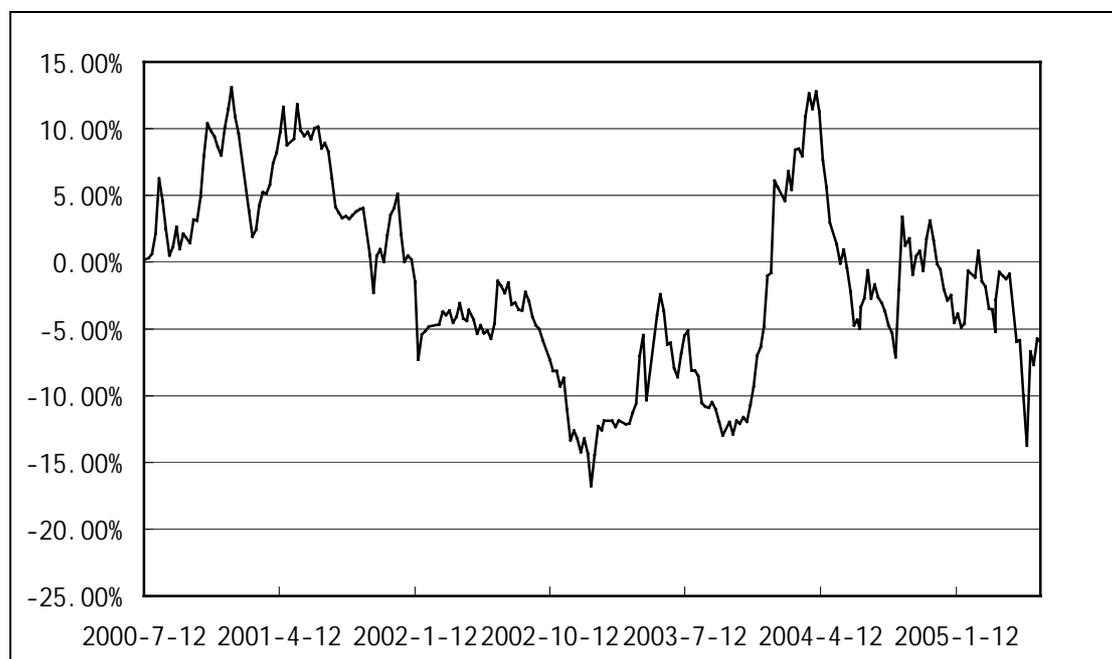
(二) 基金净值表现

1、汉博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	净值增长率 标准差	业绩比较基 准收益率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
过去一个月	4.48%	4.62%	-	-	-	-
过去三个月	-0.79%	3.50%	-	-	-	-
过去六个月	-3.56%	2.77%	-	-	-	-
过去一年	-1.02%	2.41%	-	-	-	-
过去三年	-4.62%	2.07%	-	-	-	-
自基金成立起 至今	-5.95%	1.91%				

注：由于基金汉博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博证券投资基金累计份额净值增长率历史走势图



注：由于基金汉博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四只开放式证券投资基金。

2、基金经理小组

丁加波先生，基金经理，1974 年出生，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、汉博基金经理助理、动态平衡基金经理助理。

(二) 遵规守信说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为汉博证券投资基金的管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《汉博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

2005 年上半年，利好政策频频颁布：保险资金直接入市、降低印花税、央企试点股权分置、QFII 额度大幅提高、设立投资者保护基金等等，但大盘呈现反复探底走势，重心大幅下移，全部 A 股的加权平均市盈率创 96 年以来新低。究其原因主要有三：一是宏观经济上升周期见顶预期始终没有消退；二是股权分置改革使投资者产生对未来市场大幅扩容的预期；三是证券市场政策始终选择的是

防守性政策，对投资者的信心只产生脉冲性作用。

市场特征方面，由于系统性风险始终存在，除一些稳定性行业如高速公路、食品饮料和商业零售等行业表现较好以外，其余行业表现均差强人意，尤其是周期性行业和受汇率冲击的行业表现很差。

基金汉博上半年的投资情况好坏参半，一季度由于对国家的房地产行业调控力度和对投资者的过度理性估计不足，没有在高位及时卖出地产和钢铁股，更重要的是没有将资产配置在少数强势个股上，一季度业绩表现较差。但二季度坚持以价值投资为基准，不盲目追逐市场热点，在今年 5 月份的以中集集团为首的热门股的大幅下跌周没有受到损失。此外本基金组在仓位策略上采取了在市场下跌中逐步提高股票仓位的策略，在时机选择上取得了成功。

（四）对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望下半年，本基金组认为市场将呈现平衡市走势。

市场经过大幅下跌后，市场平均市盈率已接近国际成熟市场水平，如果考虑股权分置的含权价值，平均市盈率已低于大部分成熟市场的水平，与香港市场基本接近，国际接轨压力大幅降低，市场下跌空间有限。但另一方面，市场不确定性的因素依然很多，例如宏观调控对上市的业绩影响以及未来进一步的措施、汇率问题、股权分置的进展、新股发行和再融资等等将影响增量资金的进场速度和存量资金的持股信心。

基于上述认识，本基金下半年投资上将侧重波段操作，个股投资主要锁定两类公司，一类是稳定成长型龙头公司，另一类有绝对价值的周期性龙头公司。

四、托管人报告

中国建设银行根据《汉博证券投资基金基金合同》和《汉博证券投资基金托管协议》，托管汉博证券投资基金（以下简称汉博基金）。

本报告期，中国建设银行在汉博基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人 - 富国基金管理有限公司在汉博基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

由汉博基金管理人 - 富国基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

五、财务会计报告（未经审计）

（一）会计报告书

1、2005 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
银行存款	38,437,085.78	37,454,259.74
清算备付金	2,103,991.44	
交易保证金	350,984.95	71,530.98
应收证券清算款	157,206.34	430,908.96
应收股利	132,188.64	
应收利息	991,048.67	1,244,175.14
应收申购款		
其他应收款		
股票投资市值	309,688,768.21	312,135,193.49
其中：股票投资成本	315,325,580.28	316,334,386.85
债券投资市值	91,296,700.00	108,957,000.00
其中：债券投资成本	90,951,824.10	110,647,739.15
配股权证		
买入返售证券		
待摊费用		
其他资产		
资产合计	443,157,974.03	460,293,068.31
负债及基金持有人权益		
应付证券清算款		899,809.45
应付赎回款		
应付赎回费		
应付管理人报酬	532,152.44	587,705.19
应付托管费	88,692.07	97,950.85
应付佣金	535,127.03	549,392.38
应付利息		
应付收益		
未交税金		

其他应付款	294,471.56	258,471.56
卖出回购证券款		
预提费用	153,726.92	50,000.00
其他负债		
负债合计	1,604,170.02	2,443,329.43
持有人权益		
实收基金	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	-5,291,936.17	-5,889,932.51
未分配收益	-53,154,259.82	-36,260,328.61
持有人权益合计	441,553,804.01	457,849,738.88
负债及基金持有人权益合计	443,157,974.03	460,293,068.31

后附附注为本会计报表的组成部分

2、2005 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	-12,651,115.69	41,500,837.57
1、股票差价收入	-18,933,017.67	35,928,577.37
2、债券差价收入	-23,211.13	1,433,664.26
3、债券利息收入	1,405,412.53	1,490,868.08
4、存款利息收入	249,245.48	210,407.01
5、股利收入	4,615,863.81	2,391,806.25
6、买入返售证券收入		
7、其他收入	34,591.29	45,514.60
二、费用	4,242,815.52	4,643,242.86
1、基金管理人报酬	3,363,429.75	3,672,424.80
2、基金托管费	560,571.65	612,070.87
3、卖出回购证券支出	144,767.12	187,464.68
4、利息支出		
5、其他费用	174,047.00	171,282.51
其中：上市年费	29,752.78	29,835.26
信息披露费	99,178.95	99,453.90
审计费用	24,795.19	24,863.02
三、基金净收益	-16,893,931.21	36,857,594.71
加：本期未实现利得	597,996.34	-51,571,513.22

四、基金经营业绩 -16,295,934.87 -14,713,918.51

后附附注为本会计报表的组成部分。

3、2005 年上半年度收益分配表

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	-16,893,931.21	36,857,594.71
加：期初基金净收益	-36,260,328.61	-78,837,889.03
加：以前年度损益调整		
可供分配基金净收益	-53,154,259.82	-41,980,294.32
减：本期已分配基金净收益		
期末基金净收益	-53,154,259.82	-41,980,294.32

后附附注为本会计报表的组成部分

4、2005 年上半年度净值变动表

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	457,849,738.88	460,798,826.99
二、本期经营活动		
基金净收益	-16,893,931.21	36,857,594.71
未实现利得	597,996.34	-51,571,513.22
经营活动产生的基金净值变动数	-16,295,934.87	-14,713,918.51
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		
五、期末基金净值	441,553,804.01	446,084,908.48

后附附注为本会计报表的组成部分。

(二) 会计报表附注

1、会计报表编制基础

本基金的会计报表和会计报表附注系按照《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》、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》及其细则和基金合同的规定，以及中国证券监督管理委员会允许的如主要会计政策所述的基金行业的实务操作约定而编制。

2、主要会计政策

1) **会计年度**：自公历1月1日至12月31日。本会计期间自2005年1月1日至2005年6月30日。

2) **记账本位币**：人民币

3) **记账基础和计价原则**：本基金的会计核算以权责发生制为计价基础，除股票和债券投资按市值计价外，其余均以历史成本为计价基础。

4) 基金资产的估值原则

- A. 上市股票以估值日证券交易所挂牌的市场平均价估值；该日无交易的，以最近交易日平均价估值；
- B. 未上市的股票分两种情况处理：配股和增发新股，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；首次公开发行的股票，按成本估值；
- C. 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；
- D. 上市债券以不含息价格计价，按估值日证券交易所挂牌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计提利息；
- E. 未上市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逐日计提利息；
- F. 银行存款应收利息系按银行存款日余额从上一收息日逐日计息至估值日；
- G. 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，按最能反映公允价值的方法估值；
- H. 估值对象为基金所拥有的股票、债券和银行存款等资产；
- I. 每个工作日均对基金资产进行估值；

J. 如有新增事项，按国家最新规定估值。

5) 证券投资的成本计价方法

按移动加权平均法计算库存证券的成本。当日同时有买入和卖出时，先计算买入成本后再计算买卖证券价差。

A. 股票

a 上交所买入股票成本：由买入金额、买入印花税、买入过户费、买入经手费、买入证管费和买入佣金组成；

b 深交所买入股票成本：由买入金额、买入印花税、买入经手费和买入佣金组成；

c 上海股票的佣金是按买卖股票成交金额的1‰减去经手费和证管费计算。深圳股票的佣金是按买卖股票成交金额的1‰减经手费计算。

B. 债券

a 买入上市债券按应支付的全部价款入账，如果应支付的价款中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。买入非上市债券按实际支付的全部价款入账，如果实际支付的价款中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。债券交易不计佣金。

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：

a 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；

b 卖出银行间市场交易债券--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. 债券利息收入按实际持有期内逐日计提，并按债券票面价值与票面利率计提的金额入账；
- D. 存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
- E. 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入账；
- F. 买入返售证券收入按融出资金额及约定利率在回购期限内逐日计提的金额入账；
- G. 其他收入于实际收到时确认收入。

8) 费用的确认和计量

基金费用包括管理人报酬、基金托管费、卖出回购证券支出、利息支出和其他费用。

- A. 管理人报酬和基金托管费按照基金合同和招募说明书规定的方法和标准计提，并按计提的金额入帐。
- B. 卖出回购证券支出在该证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入帐。
- C. 利息支出在借款期内逐日计提，按借款本金与适用的利率计提的金额入帐。
- D. 除上述基金费用以外的其他各项费用，如注册登记费、上市年费、信息披露费、审计费用和律师费用等，如果影响计算日基金净值小数点后第五位的，采取待摊和预提的方法，否则发生时作为基金费用一次计入基金损益。待摊或预提计入基金费用数额的多少，以不影响计算日基金净值小数点后第五位为准。

9) 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%，并采取现金方式进行；
- B. 基金收益每年至少分配一次；
- 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. 每一基金单位享有同等分配权。

10) 税项

- A. 印花税

基金管理人运用基金买卖股票2005年1月24日前按照2‰的税率征收印花税，2005年1月24日后按1‰征收印花税。

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

对基金取得的债券的利息收入及储蓄利息收入，由债券发行企业和银行在向基金派发债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；对基金在2005年6月13日前取得股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴20%的个人所得税；对基金在2005年6月13日后取得股票的股息、红利收入，根据财税[2005]102号文通知，减按50%计算应纳税所得额，即上市公司在向基金派发股息、红利收入时按10%代扣代缴个人所得税。

- 11) 本基金本期无处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计。
- 12) 本基金本期无会计政策、会计估计的变更。
- 13) 本基金本期无重大会计差错的内容和更正金额。

3、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
中国建设银行	基金托管人
天同证券有限责任公司	基金发起人
海通证券股份有限公司	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	基金管理人的股东
山东省国际信托投资有限公司	基金管理人的股东
加拿大蒙特利尔银行	基金管理人的股东

2) 关联方交易

本基金在本报告期与关联方进行的关联交易是在正常业务中按照一般商业条款而订立的，且关联交易是按照市场公允价进行定价的。

3) 通过关联方席位进行的交易

关联方名称	2005 年上半年度		2004 年上半年度	
	成交金额 (元)	占报告期股票成交总额的比例 (%)	成交金额 (元)	占报告期股票成交总额的比例 (%)
海通证券	389,580,531.93	25.14	217,283,494.44	26.48
申银万国	431,790,768.01	27.87	147,296,821.14	17.95
债券投资	成交金额 (元)	占报告期债券成交总额的比例 (%)	成交金额 (元)	占报告期债券成交总额的比例 (%)
海通证券	26,553,827.62	30.10	11,966,207.80	35.75
申银万国	20,952,101.00	23.75	12,281,778.19	36.69
债券回购	成交金额 (元)	占报告期回购成交总额的比例 (%)	成交金额 (元)	占报告期回购成交总额的比例 (%)
海通证券	50,000,000.00	27.35		
申银万国	42,400,000.00	23.19	121,000,000.00	41.87
佣 金	佣 金 (元)	占报告期佣金总量的比例 (%)	佣 金 (元)	占报告期佣金总量的比例 (%)
海通证券	310,715.49	24.80	173,971.81	26.41
申银万国	353,530.37	28.22	119,452.96	18.14

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‰, 该金额应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货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。1‰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得的服务主要包括: 有关宏观经济形势与经

济政策、国内外金融市场动态、行业与上市公司动态以及各类专题研究报告等内容的一揽子研究成果。

B. 关联方报酬

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1.5%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：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

- b. 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，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(元)	本期计提(元)	本期支付(元)	本期余额(元)
2005年上半年度	587,705.19	3,363,429.75	3,418,982.50	532,152.44
2004年上半年度	568,095.45	3,672,424.80	3,678,915.61	561,604.64

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. 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，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(元)	本期计提(元)	本期支付(元)	本期余额(元)
2005年上半年度	97,950.85	560,571.65	569,830.43	88,692.07
2004年上半年度	94,682.59	612,070.87	613,152.68	93,600.78

与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易

- a. 银行间同业市场债券交易

本基金本期及2004年上半年度与托管行未进行银行间同业市场的债券交易。

- b. 融资回购业务交易

融资回购业务	成交金额(元)	利息收入(元)	利息支出(元)
2005年上半年度			
2004年上半年度	110,000,000.00		49,427.95

注：本基金本期与托管行未进行融资回购业务交易

4、会计报表重要项目注释：

1) 应收利息

项 目	金 额 (元)
银行存款利息	7,252.02
清算备付金利息	946.80
债券利息	982,849.85
买入返售证券利息	
合 计	991,048.67

2) 待摊费用

项 目	金 额 (元)
注册登记费	
信息披露费	
审计费用	
律师费用	
上市年费	
合 计	

注：本基金本期无待摊费用余额

3) 投资估值增值

种 类	2005-06-30		
	成本 (元)	市值 (元)	估值增值 (元)
股票投资	315,325,580.28	309,688,768.21	-5,636,812.07
债券投资	90,951,824.10	91,296,700.00	344,875.90
合 计	406,277,404.38	400,985,468.21	-5,291,936.17

4) 应付佣金

券商名称	金 额 (元)
海通证券	143,639.83
国泰君安	106,609.92
申银万国	154,367.74
湘财证券	130,509.54
合 计	535,127.03

5) 其他应付款

项 目	金 额 (元)
深市股利税金	95,851.31
可转债红利税金	6,570.00
应付券商费用	150,000.00
预扣深圳分支席位运行费	36,000.00
应付债券账户维护费	6,050.25
合 计	294,471.56

6) 预提费用

项 目	金 额 (元)
注册登记费	
信息披露费	99,178.95
审计费用	24,795.19
律师费用	
上市年费	29,752.78
合 计	153,726.92

7) 股票差价收入

项 目	金 额 (元)
卖出股票成交总额	776,429,493.72
卖出股票成本总额	794,709,670.38
股票差价收入	-18,933,017.67

8) 债券差价收入

项 目	金 额 (元)
卖出债券成交总额	65,599,479.05
卖出债券成本总额	64,414,117.34
卖出债券应收利息总额	1,208,572.84
债券差价收入	-23,211.13

9) 其他收入

项 目	金 额 (元)
配股手续费返还	
新股手续费返还	34,591.29
其 他	
合 计	34,591.29

10) 其他费用

项 目	金 额 (元)
注册登记费	
上市年费	29,752.78
信息披露费	99,178.95
审计费用	24,795.19
律师费用	
其 他：	
银行费用	8,981.18
交易所费用	500.00
债券账户维护费	10,110.00

回购交易费用	728.90
合 计	174,047.00

10) 本期已分配基金净收益

本基金本期未进行收益分配。

11) 期末流通受限的基金资产

本基金截至2005年6月30日止流通受限制的股票情况如下：

序号	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	登海种业	2005/04/01	2005/04/18	2005/07/20	26,514	442,783.80	588,080.52	网下中签未流通	行情均价
2	广州国光	2005/04/27	2005/05/23	2005/08/23	58,178	628,322.40	676,610.14	网下中签未流通	行情均价
3	轴研科技	2005/04/30	2005/05/26	2005/08/26	31,879	203,706.81	384,141.95	网下中签未流通	行情均价
4	成霖股份	2005/05/12	2005/05/31	2005/08/31	35,789	307,785.40	329,974.58	网下中签未流通	行情均价
5	晶源电子	2005/05/18	2005/06/06	2005/09/06	92,558	442,427.24	978,338.06	网下中签未流通	行情均价
6	三花股份	2005/05/20	2005/06/07	2005/09/07	67,962	502,239.18	697,969.74	网下中签未流通	行情均价
7	包头铝业	2005/04/15	2005/05/09	2005/08/09	263,660	922,810.00	1,001,908.00	网下中签未流通	行情均价
8	中材国际	2005/03/25	2005/04/12	2005/07/12	56,567	425,949.51	905,637.67	网下中签未流通	行情均价
合 计						<u>3,876,024.34</u>	<u>5,562,660.66</u>		

5、承诺事项

无需要说明的重大承诺事项。

6、期后事项

无需要说明的重大期后事项。

7、其他重要事项

无需要说明的其他重要事项。

六、投资组合报告(2005年6月30日)

(一) 基金资产组合情况

截至2005年6月30日,汉博证券投资基金资产净值为441,553,804.01元,单位基金净值为0.8831元,累计单位基金净值为0.8931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	309,688,768.21	69.88
2	债 券	91,296,700.00	20.60
3	银行存款及清算备付金	40,541,077.22	9.15
4	其他资产	1,631,428.60	0.37

	合 计	443,157,974.03	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	588,080.52	0.13
2	B 采掘业	19,045,200.00	4.31
3	C 制造业	140,868,751.86	31.90
	C0 食品、饮料		
	C1 纺织、服装、皮毛	78,150.00	0.02
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷	33,196,962.78	7.52
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	28,164,548.54	6.38
	C5 电子	13,240,228.20	3.00
	C6 金属、非金属	23,221,882.58	5.26
	C7 机械、设备、仪表	36,722,146.41	8.32
	C8 医药、生物制品	6,244,833.35	1.41
	C9 其他制造业		
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	18,689,225.05	4.23
5	E 建筑业	905,637.67	0.21
6	F 交通运输、仓储业	68,416,553.18	15.49
7	G 信息技术业	35,512,394.75	8.04
8	H 批发和零售贸易		
9	I 金融、保险业	16,525,000.00	3.74
10	J 房地产业		
11	K 社会服务业		
12	L 传播与文化产业		
13	M 综合类	9,137,925.18	2.07
	合 计	309,688,768.21	70.14

(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	600269	赣粤高速	2,660,000	25,642,400.00	5.81
2	600009	上海机场	1,260,082	20,917,361.20	4.74
3	600308	华泰股份	2,050,110	20,357,592.30	4.61
4	600835	上海机电	4,268,765	19,807,069.60	4.49
5	600028	中国石化	5,380,000	19,045,200.00	4.31
6	600886	国投电力	2,380,793	18,689,225.05	4.23

7	600050	中国联通	7,000,000	18,480,000.00	4.19
8	600271	航天信息	1,260,725	17,032,394.75	3.86
9	600592	龙溪股份	2,061,584	15,832,965.12	3.59
10	600019	宝钢股份	3,000,000	15,030,000.00	3.40
11	600963	岳阳纸业	1,868,904	12,839,370.48	2.91
12	600012	皖通高速	1,654,450	11,002,092.50	2.49
13	600087	南京水运	2,700,174	10,854,699.48	2.46
14	600636	三爱富	1,352,611	10,645,048.57	2.41
15	000755	山西三维	1,700,000	9,707,000.00	2.20
16	000662	索芙特	1,080,133	9,137,925.18	2.07
17	600036	招商银行	1,500,000	9,015,000.00	2.04
18	600423	柳化股份	1,164,307	7,812,499.97	1.77
19	600000	浦发银行	1,000,000	7,510,000.00	1.70
20	600005	武钢股份	2,000,000	6,860,000.00	1.55
21	600563	法拉电子	1,008,000	6,713,280.00	1.52
22	000513	丽珠集团	1,212,589	6,244,833.35	1.41
23	600330	天通股份	1,400,000	4,872,000.00	1.10
24	600472	包头铝业	263,660	1,001,908.00	0.23
25	002049	晶源电子	92,558	978,338.06	0.22
26	600970	中材国际	56,567	905,637.67	0.21
27	002050	三花股份	67,962	697,969.74	0.16
28	002045	广州国光	58,178	676,610.14	0.15
29	002041	登海种业	26,514	588,080.52	0.13
30	002046	轴研科技	31,879	384,141.95	0.09
31	002047	成霖股份	35,789	329,974.58	0.07
32	002042	飞亚股份	15,000	78,150.00	0.02

(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	600005	武钢股份	48,510,311.70	10.60
2	600019	宝钢股份	46,603,868.35	10.18
3	600050	中国联通	31,482,521.25	6.88
4	600028	中国石化	31,078,707.06	6.79
5	600009	上海机场	29,425,762.05	6.43
6	600000	浦发银行	22,535,249.27	4.92
7	600330	天通股份	20,939,096.60	4.57
8	600835	上海机电	20,783,483.47	4.54
9	000898	鞍钢新轧	20,668,984.69	4.51
10	600012	皖通高速	19,083,363.70	4.17

11	600308	华泰股份	18,740,507.85	4.09
12	600271	航天信息	18,390,676.69	4.02
13	600258	首旅股份	17,786,558.95	3.88
14	600087	南京水运	16,927,616.43	3.70
15	000937	金牛能源	16,768,337.59	3.66
16	000755	山西三维	16,049,709.04	3.51
17	600886	国投电力	16,002,984.62	3.50
18	600592	龙溪股份	14,989,416.12	3.27
19	000422	湖北宜化	14,895,118.11	3.25
20	600900	长江电力	14,575,895.43	3.18
21	600036	招商银行	14,363,854.35	3.14
22	600269	赣粤高速	13,819,108.37	3.02
23	000581	威孚高科	13,713,437.09	3.00
24	000402	金融街	12,721,825.10	2.78
25	600123	兰花科创	12,137,239.14	2.65
26	000002	万科A	12,128,933.51	2.65
27	000989	九芝堂	11,704,621.39	2.56
28	000513	丽珠集团	11,546,654.77	2.52
29	600153	建发股份	11,342,295.76	2.48
30	000825	太钢不锈	11,306,237.43	2.47
31	000060	中金岭南	11,296,264.76	2.47
32	600188	兖州煤业	11,153,784.58	2.44
33	000662	索芙特	11,097,543.51	2.42
34	600383	金地集团	10,828,658.55	2.37
35	600636	三爱富	10,450,843.81	2.28
36	600002	齐鲁石化	10,449,262.86	2.28
37	600360	华微电子	9,578,371.66	2.09
38	600205	山东铝业	9,422,045.02	2.06

2. 报告期内累计卖出价值超过基金资产净值 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	600005	武钢股份	43,472,492.60	9.49
2	600900	长江电力	40,011,500.49	8.74
3	600019	宝钢股份	39,506,468.59	8.63
4	000937	金牛能源	33,311,981.73	7.28
5	600050	中国联通	26,689,439.14	5.83
6	600028	中国石化	22,113,512.78	4.83
7	600000	浦发银行	21,926,508.99	4.79
8	000898	鞍钢新轧	21,146,312.92	4.62
9	600383	金地集团	20,928,191.45	4.57

10	600009	上海机场	20,436,074.60	4.46
11	000581	威孚高科	18,138,136.30	3.96
12	600415	小商品城	17,254,294.45	3.77
13	000402	金融街	16,995,995.76	3.71
14	600153	建发股份	16,450,054.52	3.59
15	600308	华泰股份	15,777,848.49	3.45
16	600258	首旅股份	15,624,692.85	3.41
17	600125	铁龙物流	15,249,544.13	3.33
18	600886	国投电力	14,734,320.75	3.22
19	600360	华微电子	14,661,034.39	3.20
20	000422	湖北宜化	14,473,369.15	3.16
21	600330	天通股份	13,463,374.27	2.94
22	600563	法拉电子	13,418,320.80	2.93
23	000002	万科A	12,749,829.45	2.78
24	600026	中海发展	12,234,856.91	2.67
25	000625	长安汽车	11,399,502.49	2.49
26	600123	兰花科创	11,370,597.30	2.48
27	600036	招商银行	11,313,639.14	2.47
28	000989	九芝堂	11,040,478.66	2.41
29	000825	太钢不锈	10,818,785.30	2.36
30	600002	齐鲁石化	10,778,166.79	2.35
31	000060	中金岭南	10,765,762.42	2.35
32	600790	轻纺城	10,324,589.37	2.26
33	600188	兖州煤业	10,299,962.70	2.25
34	000968	神州股份	9,916,789.09	2.17

3. 整个报告期内买入股票的成本总额为 793,700,863.81 元 ; 卖出股票的收入总额为 776,429,493.72 元。

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

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	52,364,700.00	11.86
2	金融债券	38,932,000.00	8.82
3	企业债券		
4	可转换债券		
	合计	91,296,700.00	20.68

(六) 报告期末债券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	03 国开 03	38,932,000.00	8.82
2	02 国债	25,102,500.00	5.69
3	21 国债	10,045,000.00	2.27
4	02 国债	7,984,000.00	1.81
5	21 国债	7,123,200.00	1.61

(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基金合同规定备选股票库之外的股票。
- 3、截至 2005 年 6 月 30 日，本基金的其他资产构成如下：

名称	金额(元)
交易保证金	350,984.95
证券清算款	157,206.34
应收股利	132,188.64
应收利息	991,048.67
其他应收款	
合计	1,631,428.60

- 4、截至 2005 年 6 月 30 日，本基金持有的处于转股期的可转债明细如下：

序号	债券代码	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)

本基金本期没有处于转股期的可转债。

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
31,151 户	16,050.85 份	213,746,377 份	42.75%	286,253,623 份	57.25%

2、基金前十名持有人情况

序号	持有人	持有份额（份）	持有份额占基金总份额的比例（%）
1	人寿股份	46,761,329	9.35
2	人寿集团	34,879,111	6.98
3	CITI GROUP	23,986,950	4.80
4	UBS LIMITED	18,538,654	3.71
5	中国太保	17,485,099	3.50
6	社保基金	8,213,609	1.64
7	奥伊尔	7,795,837	1.56
8	泰康人寿	6,922,627	1.38
9	王振元	5,075,063	1.02
10	湖南信托	4,368,800	0.87

注：以上数据根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的本基金前 100 名持有人名册汇总编制。

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、本公司于 2005 年 2 月 17 日在中国证券报发布《富国基金管理有限公司关于副总经理魏青离任的公告》。2005 年 3 月 16 日，中国建设银行股份有限公司第一届董事会第四次会议和 2005 年第一次临时股东大会在北京召开，会议批准张恩照先生因个人原因辞去中国建设银行股份有限公司董事长、董事。2005 年 3 月 25 日，中国建设银行股份有限公司 2005 年第二次临时股东大会和第一届董事会第六次会议在北京召开。临时股东大会和董事会会议经过审议，选举郭树清先生为中国建设银行股份有限公司董事、董事长。

3、2005 年 6 月 17 日，中国建设银行股份有限公司和美洲银行在北京共同宣布，双方签署了关于战略投资与合作的最终协议。根据协议，美洲银行将分阶段对中国建设银行股份有限公司进行投资，最终持有股权可达到 19.9%。2005 年 7 月 1 日，中国建设银行股份有限公司和淡马锡旗下的全资子公司亚洲金融控股私人有限公司（简称“亚洲金融”）在京签署了关于战略投资的最终协议。根据协议，淡马锡将通过“亚洲金融”对中国建设银行股份有限公司进行股权投资。

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 2005 年 6 月 30 日各券商股票、债券、回购交易量及佣金情况如下：

券商名称	席位数量	成交量（元）			佣金（元）
		股票	债券	回购	
海通证券	2	389,580,531.93	26,553,827.62	50,000,000.00	310,715.49
兴业证券	2	27,284,342.77			21,350.24
申银万国	1	431,790,768.01	20,952,101.00	42,400,000.00	353,530.37
国泰君安	2	364,250,797.07	16,965,052.02	30,000,000.00	291,988.89
湘财证券	1	336,525,628.78	23,744,979.38	60,400,000.00	275,118.89

券商名称	成交量比（%）			佣金占总佣金比例（%）
	股票交易量占总交易量比例	债券交易量占总交易量比例	回购交易量占总交易量的比例	
海通证券	25.14	30.10	27.35	24.80
兴业证券	1.76			1.70
申银万国	27.87	23.75	23.19	28.22
国泰君安	23.51	19.23	16.41	23.31
湘财证券	21.72	26.92	33.04	21.96

注：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。

本期租用席位的变更情况：本基金本期无开通、终止券商席位。

九、备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立汉博证券投资基金的文件
- 2、汉博证券投资基金基金合同
- 3、汉博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、汉博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：(021)53594678

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

富国基金管理有限公司

二〇〇五年八月二十五日