

汉博证券投资基金 2005 年第 3 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2005 年 10 月 25 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：基金汉博

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

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（简称中国建设银行）

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	9,495,672.54
2、基金份额本期净收益	0.0190
3、期末基金资产净值	471,102,915.16
4、期末基金份额净值	0.9422

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。

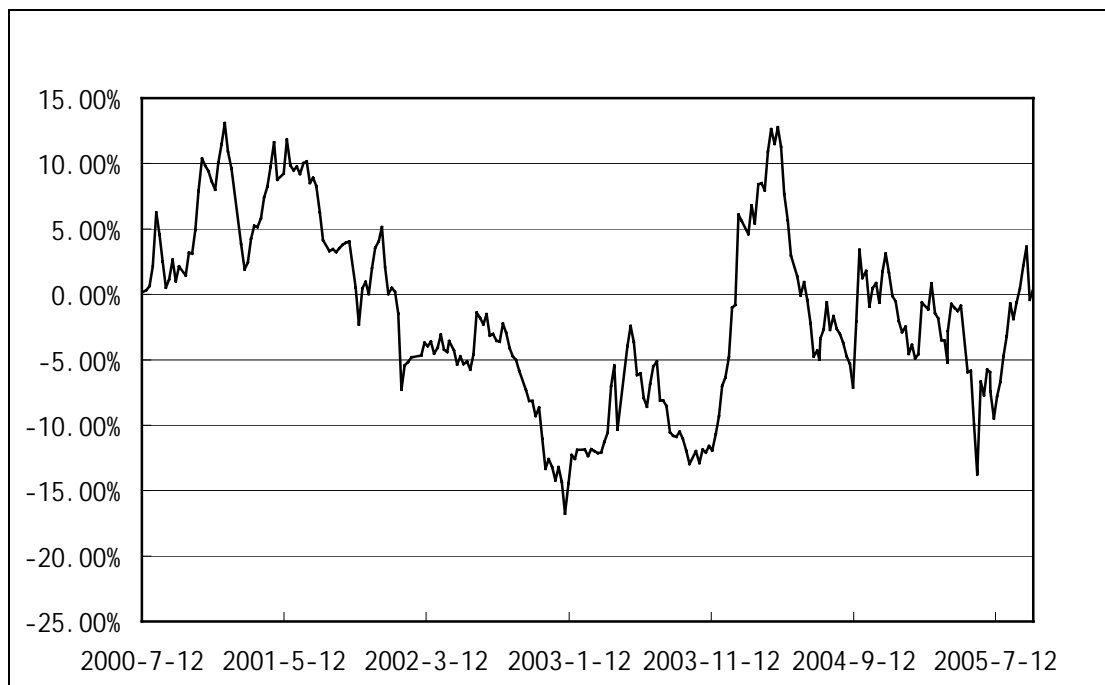
(二) 基金净值表现

1、汉博证券投资基金本期份额净值增长率表

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	-	-
过去三个月	6.69%	1.92%	-	-	-	-

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。

四、管理人报告

（一）基金管理小组

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）运作情况说明

2005 年第 3 季度，市场呈现探底回升走势。季初在第 2 批试点蓝筹股复牌后走势疲弱的影响下，大盘再次向 1000 点发出攻击，但随后券商注资传闻、人民币升值出台以及国资委和各地方政府对股改的空前支持下市场开始转暖，特别是一些 G 股的填权走势以及第 2 批试点股实施股改后的良好的市场表现，市场熊市心态初步得到扭转，市场热点开始具有持续性，市场盈利模式初具雏形。市场特征方面，由于市场信心初步得到扭转，随着股改的逐步深入，投资者开始注重市场的长期投资价值，市场热点频出，主要集中在新能源股、贵金属资源股、高油价受益股、商业地产股以及有好的对价方案的个股上。

基金汉博本季度投资业绩较理想。主要原因本基金组准确的把握本轮行情的性质，并在季初加大了操作力度，重点增持了商业地产、新能源类股，重点减持了周期性大盘股。

展望四季度行情，本基金组认为市场将呈现平衡市走势。

尽管市场在三季度得以回升，但市场平均市盈率仍处绝对低位，如果考虑股权分置的含权价值，平均市盈率仍低于大部分成熟市场的水平，与香港市场基本接近。但另一方面，市场不确定性的因素依然很多，例如宏观经济短期走势面临较大的不确定性、高油价对微观经济的影响还有待进一步观察、股权分置深入展开、新股发行和再融资对市场价值体系的冲击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，本基金四季度投资上将侧重策略投资，个股投资重点选择成长性公司、商业地产公司及高油价受益型公司。

五、投资组合报告（未经审计）

（一）基金资产组合情况

截至 2005 年 9 月 30 日，汉博证券投资基金资产净值为 471,102,915.16 元，基金份额净值为 0.9422 元，基金份额累计净值为 0.9522 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	349,855,633.52	73.59
2	债券	105,369,600.00	22.16
3	银行存款及清算备付金	18,472,075.42	3.89
4	其他资产	1,711,991.31	0.36
	合计	475,409,300.25	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		
2	B 采掘业	17,759,000.00	3.77
3	C 制造业	139,084,822.05	29.53
	C0 食品、饮料	17,090,556.18	3.63
	C1 纺织、服装、皮毛		
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷	28,702,302.78	6.09
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	13,292,140.50	2.82
	C5 电子		
	C6 金属、非金属	19,531,992.60	4.15
	C7 机械、设备、仪表	47,656,465.55	10.12
	C8 医药、生物制品	12,811,364.44	2.72
	C9 其他制造业		
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	6,450,000.00	1.37
5	E 建筑业		
6	F 交通运输、仓储业	35,809,879.51	7.60
7	G 信息技术业	61,558,370.64	13.07
8	H 批发和零售贸易	36,249,043.18	7.69
9	I 金融、保险业	18,564,000.00	3.94
10	J 房地产业	14,198,643.63	3.01

11	K 社会服务业		
12	L 传播与文化产业		
13	M 综合类	20,181,874.51	4.28
	合计	349,855,633.52	74.26

(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	600271	航天信息	1,558,719	26,872,315.56	5.70
2	600588	用友软件	1,189,352	24,429,290.08	5.19
3	600327	大厦股份	4,300,002	23,693,011.02	5.03
4	600087	南京水运	4,980,103	20,767,029.51	4.41
5	000662	索芙特	2,100,091	20,181,874.51	4.28
6	600028	中国石化	4,300,000	17,759,000.00	3.77
7	000930	丰原生化	2,520,731	17,090,556.18	3.63
8	600963	岳阳纸业	2,803,356	14,521,384.08	3.08
9	600592	龙溪股份	1,800,000	14,256,000.00	3.03
10	000402	金融街	1,600,749	14,198,643.63	3.01

(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	59,236,000.00	12.57
2	金融债券	38,932,000.00	8.26
3	可转换债券	7,201,600.00	1.53
	合计	105,369,600.00	22.37

(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	03 国开 03	38,932,000.00	8.26
2	02 国债	24,302,400.00	5.16
3	21 国债	10,231,000.00	2.17
4	21 国债	8,235,200.00	1.75
5	华菱转债	7,201,600.00	1.53

(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基金合同规定备选股票库之

外的股票。

3、截至 2005 年 9 月 30 日，本基金的其他资产项目构成如下：

序号	其他资产项目	金额（元）
1	交易保证金	74,185.00
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	1,622,682.30
5	其他应收款	
6	待摊费用	15,124.01
	合 计	1,711,991.31

4、截至 2005 年 9 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(%)
1	125932	华菱转债	7,201,600.00	1.53
2				
3				

5、截止 2005 年 9 月 30 日，本基金持有权证情况：无

六、备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立汉博基金的文件
- 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

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：(021)53594678

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

富国基金管理有限公司

二 00 五年十月二十八日