

汉盛证券投资基金 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。

基金托管人中国农业银行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	-11,499,013.83
2、基金份额本期净收益	-0.0057
3、期末基金资产净值	1,984,535,590.27
4、期末基金份额净值	0.9923

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	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	2.20%	1.86%	-	-	-	-

注：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

图



注：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）基金管理小组

李文忠先生，基金经理，1972 年出生，经济学硕士，7 年证券从业经历，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

2005 年第三季度的股市在犹豫中迎来了难得一见的季度性上涨。在人民币升值契机的推动下，在投资者对股改从观望到迟疑再到充满热情去寻宝的行为变化中，股市迎来了一波较大力度的上涨。尤其是在高对价和绩差股重组来实现对价的期望下，过去几年里跌幅最深的绩差股和部分含 B 股的 A 股大幅度上涨，而基金重仓股却受到了投资者的冷落，走势普遍落后于市场，但是部分有持续业绩增长、或严重超跌的基金持股也得到了良好的表现。

在这一季度里，本基金的业绩表现比较被动，主要是部分重点持股判断失误，表现较差，而且处理不够及时，严重拖累了基金的业绩。在第四季度里，本基金将不断总结和反思市场的变化及基金投资操作的得失，继续以公司的长期内在价值和长期发展趋势作为选股的主要标准，积极优化投资组合，力争获得较好的投资收益。

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，汉盛证券投资基金资产净值为 1,984,535,590.27 元，基金份额净值为 0.9923 元，基金份额累计净值为 1.4753 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	1,511,148,134.67	75.91
2	债券	451,568,302.40	22.68
3	银行存款及清算备付金	19,950,706.24	1.00
4	其他资产	8,070,996.23	0.41
	合计	1,990,738,139.54	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	46,353,691.44	2.34
2	B 采掘业	109,969,037.50	5.54
3	C 制造业	550,773,728.78	27.75
	C0 食品、饮料	76,610,282.78	3.86
	C1 纺织、服装、皮毛	27,620,968.12	1.39
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷	61,872,433.14	3.12
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	115,305,406.84	5.81
	C5 电子		
	C6 金属、非金属	166,768,573.80	8.40
	C7 机械、设备、仪表	36,026,766.94	1.82
	C8 医药、生物制品	66,569,297.16	3.35
	C9 其他制造业		
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	138,663,779.19	6.99
5	E 建筑业		
6	F 交通运输、仓储业	265,049,882.76	13.36
7	G 信息技术业	85,644,853.38	4.32
8	H 批发和零售贸易	32,306,581.20	1.63
9	I 金融、保险业	242,760,522.65	12.23
10	J 房地产业		
11	K 社会服务业	24,837,786.15	1.25
12	L 传播与文化产业		
13	M 综合类	14,788,271.62	0.75
	合计	1,511,148,134.67	76.15

(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	600036	招商银行	17,798,251	111,950,998.79	5.64

2	600019	G 宝 钢	25,940,719	111,026,277.32	5.59
3	600000	浦发银行	12,353,945	101,920,046.25	5.14
4	600123	兰花科创	7,776,716	84,377,368.60	4.25
5	600009	上海机场	4,770,977	74,665,790.05	3.76
6	600795	国电电力	11,162,523	74,119,152.72	3.73
7	600020	中原高速	9,016,226	64,736,502.68	3.26
8	600075	新疆天业	5,736,843	46,353,691.44	2.34
9	000895	双汇发展	3,263,670	42,590,893.50	2.15
10	000063	中兴通讯	1,439,090	40,049,874.70	2.02

(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	264,293,200.00	13.32
2	金融债券	149,933,250.00	7.56
3	可转换债券	37,341,852.40	1.88
	合 计	451,568,302.40	22.75

(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	99 国债 8	92,709,000.00	4.67
2	21 国债 15	60,362,900.00	3.04
3	02 国债 14	34,428,400.00	1.73
4	04 国开 12	30,330,000.00	1.53
5	03 国开 29	30,168,000.00	1.52

(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，本基金的其他资产构成如下：

名 称	金 额(元)
应收利息	5,871,969.38
其他应收款	500,024.36
交易保证金	80,000.00
证券清算款	1,603,878.48
待摊费用	15,124.01
合 计	8,070,996.23

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	100795	国电转债	21,800,000.00	1.10
2	110036	招行转债	8,369,600.00	0.42
3	110317	营港转债	7,172,252.40	0.36

六、本公司自有资金持有本基金的份额及变化情况

截至 2005 年 9 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