

汉盛证券投资基金
2010 年第 2 季度报告

2010 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司
基金托管人： 中国农业银行股份有限公司
报告送出日期： 2010 年 07 月 20 日

§ 1 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股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 7 月 16 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2010 年 4 月 1 日起至 2010 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------------|--|
| 基金简称 | 富国汉盛封闭 |
| 基金主代码 | 500005 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 1999 年 05 月 10 日 |
| 报告期末基金份额总额（单位：份） | 2,000,000,000.00 |
| 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。 |
| 业绩比较基准 | 无 |
| 风险收益特征 | 无 |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2010 年 04 月 01 日-2010 年 06 月 30 日） |
|-----------------|--|
| 1. 本期已实现收益 | 92,253,358.63 |
| 2. 本期利润 | -388,683,561.69 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1943 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,665,899,651.23 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.3329 |

注：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。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

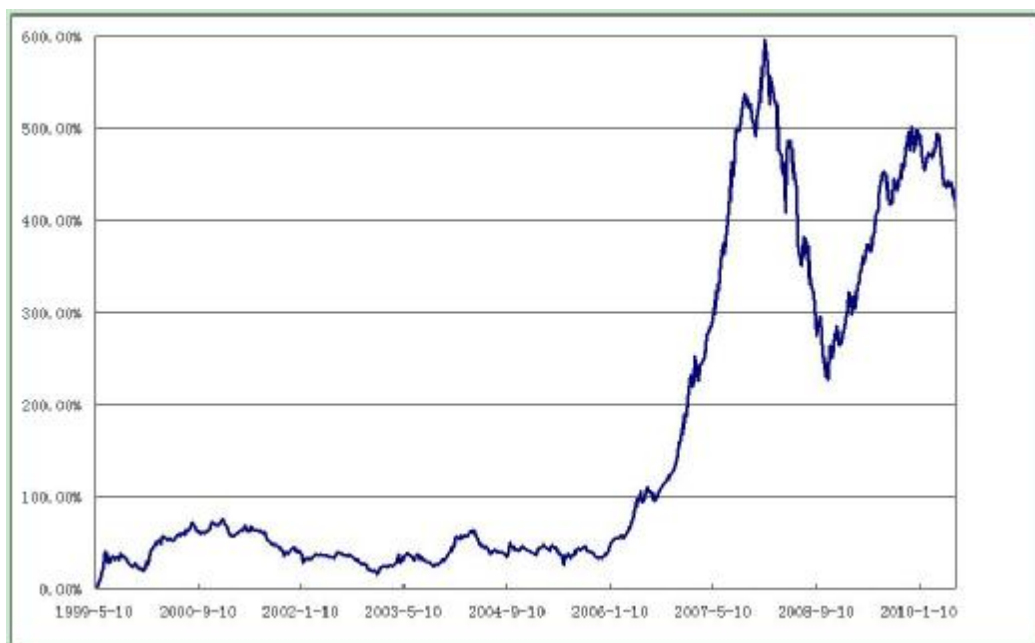
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | -12.73% | 1.84% | — | — | — | — |

注：过去三个月指 2010 年 4 月 1 日—2010 年 6 月 30 日

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：截止日期为 2010 年 6 月 30 日。由于本基金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。本基金于 1999 年 5 月 10 日成立，建仓期 6 个月，从 1999 年 5 月 10 日至 1999 年 11 月 9 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-------------|------|--------|-------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 贺轶 | 本基金基 | 2010-01-13 | — | 9 年 | 硕士，曾任中国银行云南 |

| | | | | | |
|--|-----|--|--|--|--|
| | 金经理 | | | | 省分行国际业务部银行职员；中银国际证券有限责任公司资产管理部分析员；中银基金管理有限公司投资部助理副总裁；汇丰晋信基金管理公司投资管理部投资经理、基金经理；富国基金管理有限公司营销策划与产品部高级营销策划经理、权益投资部策略分析师；2010 年 1 月至今任汉盛基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
|--|-----|--|--|--|--|

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，严格执行交易系统中的公平交易程序，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

—

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度在政策调控、经济增速预期下滑、企业盈利预期向下调整和流动性收缩压力不减的背景下，市场整体继续处于调整过程中。

二季度，基于经济和企业盈利增速预期向下调整、流动性收缩局面不改的原因，本基金适当降低了权益类资产的配置比例，从行业配置和个股选择上来看，仍以寻找结构性的投资机会为主，本基金主要增持了大消费类相关板块，减持了盈利预期受经济增速下滑影响较大的周期性板块。展望未来，本基金将继续以经济结构转型、产业结构转型和升级、城镇化等作为未来的投资主线。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2010 年 6 月 30 日，本基金二季度净值增长率为-12.73%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,686,207,114.00 | 62.92 |
| | 其中：股票 | 1,686,207,114.00 | 62.92 |
| 2 | 固定收益投资 | 644,121,090.10 | 24.04 |
| | 其中：债券 | 644,121,090.10 | 24.04 |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 3 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 4 | 买入返售金融资产 | 99,000,169.50 | 3.69 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 238,755,956.80 | 8.91 |
| 6 | 其他资产 | 11,802,983.10 | 0.44 |
| 7 | 合计 | 2,679,887,313.50 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | — | — |
| B | 采掘业 | 60,691,471.32 | 2.28 |
| C | 制造业 | 822,641,632.13 | 30.86 |
| C0 | 食品、饮料 | 170,614,725.44 | 6.40 |

| | | | |
|-----|----------------|------------------|-------|
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 23,572,428.66 | 0.88 |
| C2 | 木材、家具 | — | — |
| C3 | 造纸、印刷 | 923,490.40 | 0.03 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 226,712,465.97 | 8.50 |
| C5 | 电子 | 29,534,353.40 | 1.11 |
| C6 | 金属、非金属 | 57,581,672.93 | 2.16 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 176,407,927.88 | 6.62 |
| C8 | 医药、生物制品 | 137,294,567.45 | 5.15 |
| C99 | 其他制造业 | — | — |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 3,000,000.00 | 0.11 |
| E | 建筑业 | 53,161,606.91 | 1.99 |
| F | 交通运输、仓储业 | 16,632,000.00 | 0.62 |
| G | 信息技术业 | 66,061,735.88 | 2.48 |
| H | 批发和零售贸易 | 239,808,529.23 | 9.00 |
| I | 金融、保险业 | 354,327,205.65 | 13.29 |
| J | 房地产业 | 41,047,022.88 | 1.54 |
| K | 社会服务业 | 12,771,593.00 | 0.48 |
| L | 传播与文化产业 | 7,133,221.00 | 0.27 |
| M | 综合类 | 8,931,096.00 | 0.34 |
| | 合计 | 1,686,207,114.00 | 63.25 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|---------------|--------------|
| 1 | 002024 | 苏宁电器 | 7,806,750 | 88,996,950.00 | 3.34 |
| 2 | 600408 | 安泰集团 | 15,000,000 | 85,500,000.00 | 3.21 |
| 3 | 600703 | 三安光电 | 2,400,000 | 81,240,000.00 | 3.05 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 633,000 | 80,618,880.00 | 3.02 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 5,915,000 | 80,444,000.00 | 3.02 |
| 6 | 002007 | 华兰生物 | 1,670,120 | 75,289,009.60 | 2.82 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 1,600,000 | 71,280,000.00 | 2.67 |
| 8 | 601601 | 中国太保 | 3,062,245 | 69,727,318.65 | 2.62 |
| 9 | 600858 | 银座股份 | 2,029,991 | 51,582,071.31 | 1.93 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 3,835,950 | 49,905,709.50 | 1.87 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 409,827,143.20 | 15.37 |
| 2 | 央行票据 | 177,115,000.00 | 6.64 |
| 3 | 金融债券 | 30,018,000.00 | 1.13 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,018,000.00 | 1.13 |
| 4 | 企业债券 | 950,515.90 | 0.04 |
| 5 | 企业短期融资券 | — | — |

| | | | |
|---|-----|----------------|-------|
| 6 | 可转债 | 26,210,431.00 | 0.98 |
| 7 | 其他 | — | — |
| 8 | 合计 | 644,121,090.10 | 24.16 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|-----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 010110 | 21 国债(00) | 1,770,820 | 179,384,066.00 | 6.73 |
| 2 | 010112 | 21 国债(02) | 1,369,480 | 138,851,577.20 | 5.21 |
| 3 | 010203 | 02 国债(3) | 910,000 | 91,591,500.00 | 3.44 |
| 4 | 0901042 | 09 央票 42 | 500,000 | 49,080,000.00 | 1.84 |
| 5 | 0901046 | 09 央票 46 | 500,000 | 49,070,000.00 | 1.84 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

5.8.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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。

5.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 694,787.83 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | 278,595.00 |
| 4 | 应收利息 | 9,872,350.13 |
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | 24.36 |

| | | |
|---|------|---------------|
| 7 | 待摊费用 | 957,225.78 |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 11,802,983.10 |

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 600408 | 安泰集团 | 85,500,000.00 | 3.21 | 非公开发行股票 |
| 2 | 600703 | 三安光电 | 81,240,000.00 | 3.05 | 非公开发行股票 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 71,280,000.00 | 2.67 | 筹划重大事项 |
| 4 | 002024 | 苏宁电器 | 42,750,000.00 | 1.60 | 非公开发行股票 |

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位：份

| | |
|----------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的封闭式基金份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期期间买入总份额 | — |
| 报告期期间卖出总份额 | — |
| 报告期期末管理人持有的封闭式基金份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%) | 0.50 |

§ 7 备查文件目录

7.1 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

7.2 存放地点

上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5 层

7.3 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：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
2010 年 07 月 20 日