

# 汉鼎证券投资基金 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。

基金托管人中国工商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    | 4,964,878.05   |
| 2 基金份额本期净收益  | 0.0099         |
| 3 期末基金资产净值   | 442,850,801.78 |
| 4 期末基金份额资产净值 | 0.8857         |

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。

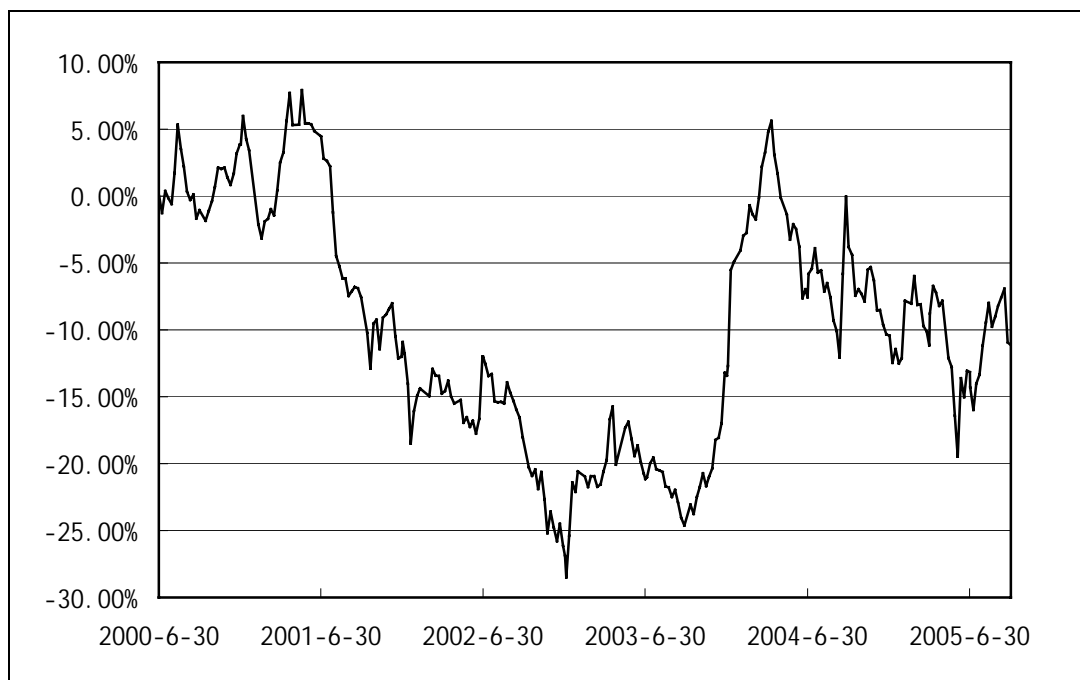
#### (二) 基金净值表现

##### 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 | 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 | 2.33% | 1.94%    | -         | -            | - | - |

注：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：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

三季度经济形势依然良好，但预期极为负面。股权分置改革的实质启动为证券市场注入了巨大的活力。正如我们中期报告所言，由股权分置改革主导的制度变革不仅仅产生对价吸引力，更大的吸引力在于变革后全新市场带来的投资机会。虽然一轮大的牛市行情不可能在紧缩背景下的宏观经济预期中产生，但是由于制度变革和经济结构调整的力量将使整个 A 股市场充满活力，存在大量局部的、微观的投资机会，我们正在通过踏踏实实的研究寻找这样的机会。尽管在寻找新的投资机会时取得了一定的效果，但由于三季度信息类股票投资比例较大，致使本基金在 9 月中旬以来市场的大幅下跌中损失惨重，为此我们感到深深的不安。在四季度的投资中我们将把风险控制作为第一要务，扎扎实实地研究上市公司，精选出被低估的股票，力争为投资者带来长期稳定的回报。

## 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，富国汉鼎证券投资基金资产净值为 442,850,801.78 元，基金份额净值为 0.8857 元，基金份额累计净值为 0.8917 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         | 325,835,316.42 | 73.35%    |
| 2  | 债券         | 95,570,332.40  | 21.52%    |
| 3  | 银行存款及清算备付金 | 21,461,394.70  | 4.83%     |
| 4  | 其他资产       | 1,331,360.47   | 0.30%     |
|    | 合计         | 444,198,403.99 | 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)          | 占基金净值的比例 |
|----|------------------|----------------|----------|
| 1  | A 农、林、牧、渔业       |                |          |
| 2  | B 采掘业            | 21,570,865.95  | 4.87%    |
| 3  | C 制造业            | 133,886,448.97 | 30.23%   |
|    | C0 食品、饮料         | 14,224,252.05  | 3.21%    |
|    | C1 纺织、服装、皮毛      |                |          |
|    | C2 木材、家具         |                |          |
|    | C3 造纸、印刷         |                |          |
|    | C4 石油、化学、塑胶、塑料   | 4,801,617.24   | 1.08%    |
|    | C5 电子            | 26,110,512.23  | 5.90%    |
|    | C6 金属、非金属        | 41,626,803.43  | 9.40%    |
|    | C7 机械、设备、仪表      | 18,262,256.46  | 4.12%    |
|    | C8 医药、生物制品       | 14,730,307.00  | 3.33%    |
|    | C99 其他制造业        | 14,130,700.56  | 3.19%    |
| 4  | D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 13,626,254.04  | 3.08%    |
| 5  | E 建筑业            |                |          |
| 6  | F 交通运输、仓储业       | 49,842,658.86  | 11.25%   |
| 7  | G 信息技术业          | 70,621,292.10  | 15.95%   |
| 8  | H 批发和零售贸易        |                |          |
| 9  | I 金融、保险业         | 28,769,653.50  | 6.50%    |
| 10 | J 房地产业           | 359.00         | 0.00%    |
| 11 | K 社会服务业          | 7,517,784.00   | 1.70%    |
| 12 | L 传播与文化产业        |                |          |
| 13 | M 综合类            |                |          |
|    | 合计               | 325,835,316.42 | 73.58%   |

## (三) 股票投资的前十名股票明细

| 序号 | 股票名称 | 股票代码   | 数量(股)      | 市值(元)         | 市值占基金资产净值比例 |
|----|------|--------|------------|---------------|-------------|
| 1  | 中国联通 | 600050 | 15,700,000 | 40,035,000.00 | 9.04%       |
| 2  | 招商银行 | 600036 | 3,000,000  | 18,870,000.00 | 4.26%       |
| 3  | 上海机场 | 600009 | 1,150,000  | 17,997,500.00 | 4.06%       |
| 4  | 双汇发展 | 000895 | 1,089,981  | 14,224,252.05 | 3.21%       |
| 5  | 安泰科技 | 000969 | 2,308,938  | 14,130,700.56 | 3.19%       |

|    |      |        |           |               |       |
|----|------|--------|-----------|---------------|-------|
| 6  | 中原高速 | 600020 | 1,809,960 | 12,995,512.80 | 2.93% |
| 7  | 福耀玻璃 | 600660 | 2,120,000 | 12,889,600.00 | 2.91% |
| 8  | 中兴通讯 | 000063 | 452,700   | 12,598,641.00 | 2.84% |
| 9  | 航天信息 | 600271 | 727,722   | 12,545,927.28 | 2.83% |
| 10 | 宝钢股份 | 600019 | 2,897,153 | 12,399,814.84 | 2.80% |

#### (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  | 73,574,332.40 | 16.61%      |
| 2  | 金融债 | 19,996,000.00 | 4.52%       |
| 3  | 可转债 |               |             |
| 4  | 企业债 | 2,000,000.00  | 0.45%       |
|    | 合计  | 95,570,332.40 | 21.58%      |

#### (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  | 00 国债 07 | 30,264,000.00 | 6.83%       |
| 2  | 04 国开 01 | 19,996,000.00 | 4.52%       |
| 3  | 02 国债    | 17,214,200.00 | 3.89%       |
| 4  | 99 国债    | 15,451,500.00 | 3.49%       |
| 5  | 03 国债    | 7,607,132.40  | 1.72%       |

#### (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：

| 其他资产项目  | 金额(元)        |
|---------|--------------|
| 交易保证金   | 300,000.00   |
| 应收证券清算款 |              |
| 应收股利    |              |
| 应收利息    | 1,016,236.46 |
| 其他应收款   |              |
| 待摊费用    | 15,124.01    |
| 合计      | 1,331,360.47 |

4、截至 2005 年 9 月 30 日，本基金未持有处于转股期的可转债。

5、截止 2005 年 9 月 30 日，本基金持有权证情况：无

## 六、本公司固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 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：(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