

富国天博创新主题股票型证券投资基金

(原汉博证券投资基金转型)

2007 年第 2 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 2007 年 7 月 17 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。

自 2007 年 4 月 27 日汉博证券投资基金终止上市日起，原汉博证券投资基金变更为富国天博创新主题股票型证券投资基金。原汉博证券投资基金报告期为 2007 年 4 月 1 日至 2007 年 4 月 26 日，富国天博创新主题股票型证券投资基金报告期为 2007 年 4 月 27 日至 2007 年 6 月 30 日。

二、基金产品概况

(一) 富国天博创新主题股票型证券投资基金

基金简称：富国天博

运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007 年 4 月 27 日

报告期末基金份额总额：6,827,015,586.36 份

投资目标：本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题类上市公司，在充分注重投资组合收益性、流动性与安全性的基础上，力争实现资本的长期稳定增值。

投资策略：本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组合风险管理全过程中。

业绩比较基准：中信标普 300 指数×80%+中信标普国债指数×15%+同业存款利率×5%

风险收益特征：本基金是一只主动投资的股票型基金，属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资基金品种。

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）

（二）原汉博证券投资基金

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

主要财务指标	转型后（自2007年4月27日起（基金合同生效日）起	转型前（自2007年4月1日起至2007年4月26日（基金合同

	至2007年6月30日止)	失效日)止)
1、基金本期净收益	4,435,610.34	64,572,087.64
2、基金份额本期净收益	0.0010	0.1291
3、期末基金资产净值	7,200,207,948.10	1,221,684,131.94
4、期末基金份额净值	1.0547	2.4434

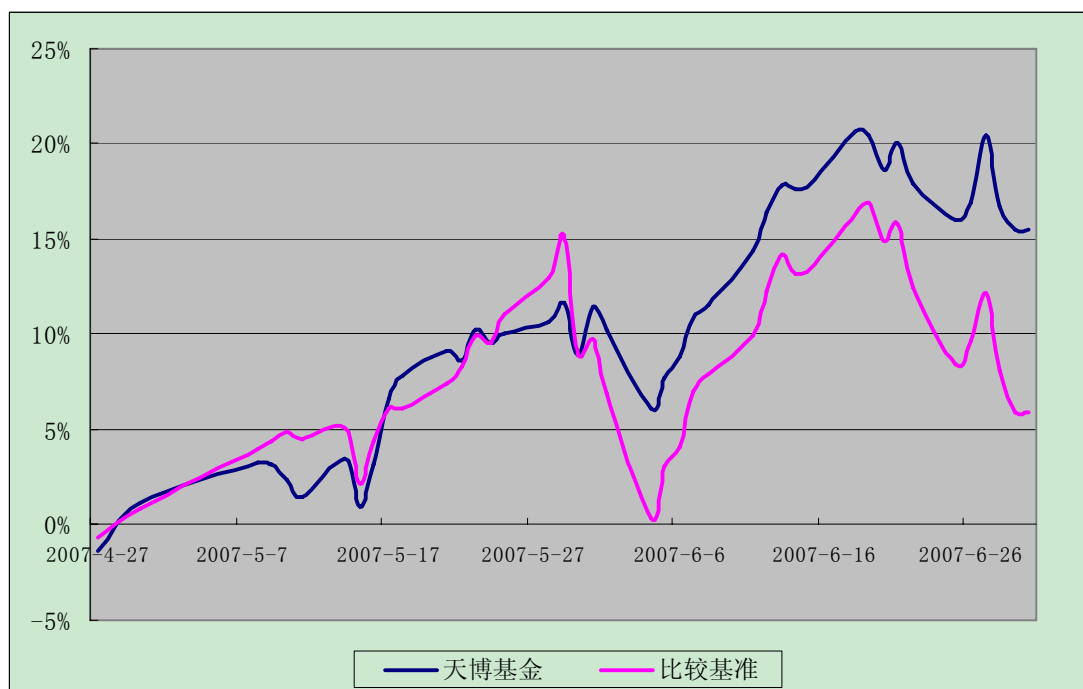
提示：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 富国天博创新主题股票型证券投资基金净值表现 (自 2007 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) 起至 2007 年 6 月 30 日止)

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
自基金成立 日起至今	15.52%	1.73%	5.96%	2.20%	9.56%	-0.47%

2、自基金合同生效以来富国天博创新主题股票型证券投资基金累计份额净值增长率历史走势图 (2007 年 4 月 27 日至 2007 年 6 月 30 日, 自合同生效日至截止日不足一年)



注：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。根据证监会《关于实施基金份额拆

分后调整基金建仓期有关问题的复函》(基金部函[2007]91 号)的要求,因基金转型而规模短期内快速增长所导致证券比例低于基金合同约定的,应在三个月内调整到位。截至报告日本基金的各项投资比例已符合基金合同的规定。

2、2007 年 4 月 5 日,汉博证券投资基金转型获基金份额持有人大会决议通过,并获中国证监会 2007 年 4 月 16 日证监基金字[2007]108 号核准。自 2007 年 4 月 27 日起,汉博证券投资基金在上海证券交易所终止上市,其由《汉博证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》正式生效。

3、富国基金管理有限公司已于 2007 年 5 月 24 日对投资者持有的原汉博证券投资基金(以下简称“基金汉博”)进行了基金份额转换操作。经本基金托管人中国建设银行确认,拆分基准日(5 月 24 日)基金份额净值为 2.6761 元,精确到小数点后第 9 位为 2.676100905 元(第 9 位以后舍去),本基金管理人按照 1: 2.676100905 的转换比例将原基金汉博的基金财产进行了拆分。拆分后,基金份额净值变为 1.0000 元,相应地,原基金汉博每 1 份基金份额转换为 2.676100905 份,基金份额计算结果保留到整数位,所产生的误差归入基金财产。原基金汉博的基金总份额由 500,000,000.00 份转换为 1,338,050,452.56 份。

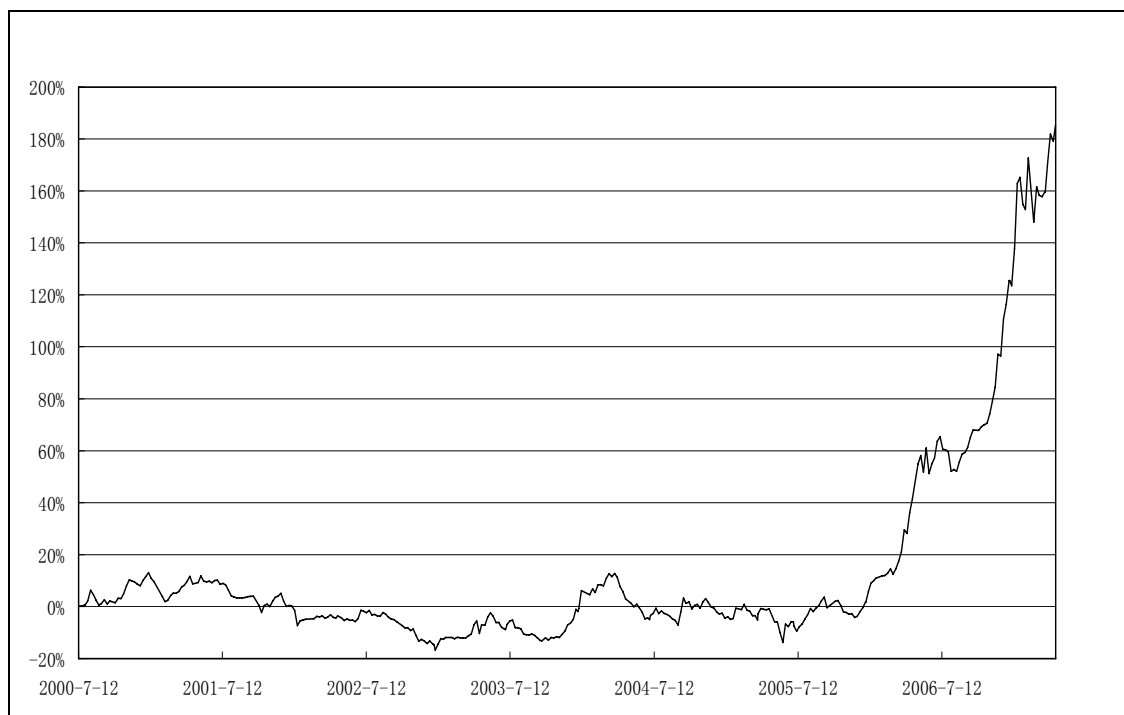
(三)原汉博证券投资基金净值表现(自 2007 年 4 月 1 日起至 2007 年 4 月 26 日(基金合同失效日)止)

1、本报告期基金份额净值增长率

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
2007 年 4 月 1 日起至 2007 年 4 月 26 日	9.87%	2.47%	—	—	—	—

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、基金汉博累计份额净值增长率历史走势图(2000 年 7 月 12 日至 2007 年 4 月 26 日)



四、管理人报告

（一）基金经理

毕天宇先生，生于 1971 年，工商管理硕士，自 2000 年开始从事证券行业工作，曾任中国北方工业上海公司内贸处销售员、兴业证券股份有限公司研究发展中心研究员、富国基金管理公司研究策划部研究员。

（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（富国天博创新主题股票型证券投资基金）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》（《富国天博创新主题股票型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

07 年 2 季度沪深市场出现了巨幅震荡，印花税提高有效抑制了市场的投机氛围，取消利息税、发行特别国债等紧缩货币政策的实施，使得市场再度出现调整。

期间基金操作分为两个阶段：

第一阶段是从 3 月 31 日至 5 月 24 日（尽管 4 月 27 日天博基金正式成立，但新资金和老组合的拆分合并是在 5 月 24 日），我们基本保持原有组合的配置，操作上也以持股为主。

第二阶段是 5 月 24 日拆分合并之后，整体规模在 60.95 亿，其中 13 亿是老基金转换过来的。基于市场可能出现震荡的判断，我们制定了相机抉择的建仓策略，即“不跌少买，小跌小买，大跌大买”。由于国家调整交易印花税，市场出现恐慌性大跌，利用这个机会我们加快了建仓的速度。截至 6 月 7 日，天博基金仓位已经增加到 70.5%。

在行业配置上，我们针对基金规模较大的特点，采取了适度均衡配置的投资策略，重点配置了短期估值压力较小、未来 6 个月盈利增长明确的行业如金融、地产、化工新材料和重卡等行业。从实际运作效果来看，5 月 24 日至 6 月 30 日中信标普 300 指数下跌 4.1%，而同期基金净值上涨 5.5%。

展望 3 季度市场，我们认为近期市场的调整使得不少人改变了后期走势的看法，市场逐步趋于理性，股指短期再度大幅上涨的难度较大。不过，基于宏观经济依旧强劲，中报业绩好于预期等因素考虑，我们相信只要我们坚持价值投资理念，挖掘真正有投资价值的上市公司，我们就有希望为投资者创造更大价值。

五、投资组合报告（未经审计）

（一）富国天博创新主题股票型证券投资基金

1、2007 年 6 月 30 日基金资产组合情况

截至 2007 年 6 月 30 日，富国天博创新主题股票型证券投资基金资产净值为 7,200,207,948.10 元，基金份额净值为 1.0547 元，基金份额累计净值为 2.8225 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	6,361,738,671.69	84.99%
2	债券	310,416,397.76	4.15%
3	权证	0.00	0.00%
4	银行存款及清算备付金	734,434,406.41	9.81%

5	其他资产	78,493,051.51	1.05%
	合计	7,485,082,527.37	100.00%

2、2007 年 6 月 30 日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	329,662,185.28	4.58%
3	C 制造业	2,608,920,645.05	36.24%
	C0 食品、饮料	402,866,223.60	5.60%
	C1 纺织、服装、皮毛		
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷	59,850,703.00	0.83%
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	618,630,856.89	8.59%
	C5 电子	11,650,144.13	0.16%
	C6 金属、非金属	727,163,437.89	10.10%
	C7 机械、设备、仪表	588,869,530.06	8.18%
	C8 医药、生物制品	199,889,749.48	2.78%
	C9 其他制造业		
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	171,364,366.16	2.38%
5	E 建筑业		
6	F 交通运输、仓储业	403,942,331.27	5.61%
7	G 信息技术业	474,208,683.37	6.59%
8	H 批发和零售贸易	526,440,162.11	7.31%
9	I 金融、保险业	1,320,472,605.95	18.34%
10	J 房地产业	467,031,314.30	6.49%
11	K 社会服务业	59,696,378.20	0.83%
12	L 传播与文化产业		
13	M 综合类		
	合计	6,361,738,671.69	88.35%

3、2007 年 6 月 30 日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	18,002,118.00	442,492,060.44	6.15%
2	002024	苏宁电器	7,713,088.00	362,206,612.48	5.03%
3	600519	贵州茅台	2,543,539.00	304,410,747.52	4.23%
4	600309	烟台万华	4,104,416.00	219,832,520.96	3.05%
5	601318	中国平安	3,063,636.00	219,080,610.36	3.04%
6	000063	中兴通讯	4,021,673.00	218,779,011.20	3.04%

7	600030	中信证券	4,053,372.00	214,707,114.84	2.98%
8	600596	新安股份	4,501,323.00	194,412,140.37	2.70%
9	600000	浦发银行	5,004,578.00	183,117,509.02	2.54%
10	600009	上海机场	4,501,506.00	171,102,243.06	2.38%

4、2007 年 6 月 30 日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	77,521,730.50	1.08%
2	央行票据	232,894,667.26	3.23%
	合 计	310,416,397.76	4.31%

5、2007 年 6 月 30 日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	07 央行票据 25	194,092,931.78	2.70%
2	21 国债(3)	59,976,978.00	0.83%
3	07 央行票据 53	38,801,735.48	0.54%
4	02 国债(14)	17,544,752.50	0.24%

6、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备选股票库之外的股票。

(3) 截至 2007 年 6 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	140,741.00
2	应收利息	2,566,593.12
3	应收股利	2,064,199.59
4	应收申购款	73,721,517.80
	合 计	78,493,051.51

(4) 截至 2007 年 6 月 30 日，本基金未持有处于转股期的可转债。

(5) 本基金本报告期内及本报告期末均不持有资产支持证券。

(6) 本基金本报告期末主动投资权证，未获得因股权分置改革而产生的权证。

(7) 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。

(8) 本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金情况

项目名称	基金份额（份）
------	---------

报告期期初持有基金份额(原汉博基金份额)	21,904,143.00
报告期间买入基金份额	0
报告期间基金拆折算份额	36,713,554.00
报告期间卖出基金份额	0
报告期末持有基金份额	58,617,697.00

(二) 原汉博证券投资基金(截至 2007 年 4 月 26 日)

1、2007 年 4 月 26 日基金资产组合情况

截至 2007 年 4 月 26 日,汉博证券投资基金资产净值为 1,221,684,131.94 元,基金份额净值为 2.4434 元,基金份额累计净值为 2.6766 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	971,041,867.92	79.36%
2	债券	245,502,473.70	20.06%
3	权证	0.00	0.00%
4	银行存款及清算备付金	3,485,514.37	0.28%
5	其他资产	3,531,473.28	0.29%
	合计	1,223,561,329.27	100.00%

2、2007 年 4 月 26 日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		
3	C 制造业	428,217,376.39	35.05%
	C0 食品、饮料	121,810,893.84	9.97%
	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	142,637,070.57	11.68%
	C5 电子	1,276,183.79	0.10%
	C6 金属、非金属	67,930,920.00	5.56%
	C7 机械、设备、仪表	44,325,867.16	3.63%
	C8 医药、生物制品	50,236,441.03	4.11%
	C9 其他制造业		
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业		
5	E 建筑业		
6	F 交通运输、仓储业	23,557,500.00	1.93%
7	G 信息技术业	105,617,666.03	8.65%
8	H 批发和零售贸易	115,475,000.00	9.45%

9	I 金融、保险业	237,769,325.50	19.46%
10	J 房地产业	60,405,000.00	4.94%
11	K 社会服务业		
12	L 传播与文化产业		
13	M 综合类		
	合计	971,041,867.92	79.48%

3、2007 年 4 月 26 日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	6,046,756	121,358,392.92	9.93%
2	002024	苏宁电器	3,100,000	115,475,000.00	9.45%
3	600271	航天信息	2,400,000	105,072,000.00	8.60%
4	600519	贵州茅台	1,003,790	96,996,227.70	7.94%
5	600309	烟台万华	1,987,000	83,275,170.00	6.82%
6	600030	中信证券	1,203,495	63,039,068.10	5.16%
7	600143	金发科技	2,001,990	58,398,048.30	4.78%
8	000039	中集集团	1,800,000	48,168,000.00	3.94%
9	601628	中国人寿	1,007,660	39,238,280.40	3.21%
10	600383	金地集团	1,500,000	33,030,000.00	2.70%

4、2007 年 4 月 26 日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	181,602,218.70	14.86%
2	金融债券	63,900,255.00	5.23%
	合计	245,502,473.7	20.10%

5、2007 年 4 月 26 日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	20 国债(10)	68,366,820.90	5.60%
2	02 国债(14)	61,716,253.50	5.05%
3	03 国开 03	38,932,000.00	3.19%
4	21 国债(3)	30,520,236.00	2.50%
5	05 农发 15	19,990,000.00	1.64%

6、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备选股票库之外的股票。

(3) 截至 2007 年 4 月 26 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	140,741.00
2	应收利息	3,390,732.28
	合 计	3,531,473.28

(4) 截至 2007 年 4 月 26 日, 本基金未持有处于转股期的可转债。

(5) 本基金本报告期内及本报告期末均不持有资产支持证券。

(6) 本基金本报告期末主动投资权证, 未获得因股权分置改革而产生的权证。

(7) 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。

(8) 本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金情况

项目名称	基金份额 (份)
报告期期初持有基金份额	21,904,143.00
报告期内买入基金份额	0
报告期内卖出基金份额	0
报告期末持有基金份额	21,904,143.00

六、开放式基金份额变动(富国天博创新主题

股票型证券投资基金 单位: 份)

本报告期初基金份额总额	500,000,000.00
本报告期间基金总申购份额	6,779,344,616.94
其中: 基金拆分折算份额总额	838,050,452.56
申购份额总额	5,941,294,164.38
本报告期间基金总赎回份额	452,329,030.58
本报告期末基金份额总额	6,827,015,586.36

七、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、中国证监会《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》
- 6、富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同

- 7、富国天博创新主题股票型证券投资基金托管协议
- 8、汉博证券投资基金财务报表及报表附注
- 9、富国天博创新主题股票型证券投资基金财务报表及报表附注
- 10、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

查阅地点：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5 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：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

二〇〇七年七月十九日