

# 富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF） 二 00 六年半年度报告

报告期年份：二 00 六年

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二 00 六年八月二十九日

## 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于 2006 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、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。

## 目 录

一、基金简介.....	1
二、主要财务指标和基金净值表现.....	2
(一) 主要财务指标.....	2
(二) 基金净值表现.....	3
三、管理人报告.....	4
(一) 基金管理人及基金经理小组情况.....	4
(二) 遵规守信说明.....	4
(三) 对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明与解释.....	4
(四) 对宏观经济、证券市场及行业走势的展望.....	5
四、托管人报告.....	5
五、财务会计报告 (未经审计) .....	6
(一) 会计报告书.....	6
(二) 会计报表附注.....	9
六、投资组合报告 (2006 年 6 月 30 日) .....	21
(一) 基金资产组合情况.....	21
(三) 报告期末股票投资明细.....	22
(四) 报告期内股票投资组合的重大变动.....	23
(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合 .....	25
(六) 报告期末债券投资的前五名债券明细 .....	25
(七) 投资组合报告附注.....	26
七、基金份额持有人户数、持有人结构.....	26
八、基金份额变动.....	27
九、重大事件揭示.....	27
十、备查文件目录.....	29

## 一、基金简介

(一) 基金名称：富国天惠精选成长混合型证券投资基金 (LOF)

基金简称：富国天惠

交易代码：161005

运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2005 年 11 月 16 日

报告期末基金份额总额：348,136,011.40 份

(二) 投资目标：本基金主要投资于具有良好成长性且合理定价的股票，在利用金融工程技术控制组合风险的前提下，谋求基金资产的长期最大化增值。

投资策略：本基金采用主动投资管理策略，基于“快速成长、合理定价”的选股标准精选个股，并在坚持以基本面研究驱动投资的基础上进行适度的选时操作，争取投资收益的最大化。

业绩比较基准：中信标普 300 指数×70%+中信国债指数×25%+同业存款利率×5%

风险收益特征：本基金是一只主动投资的混合型基金，主要投资于具有良好成长性且合理定价的股票，风险和预期收益匹配，属于风险适中的证券投资基金品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产长期稳定增长。

(三) 基金管理人：富国基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦 13、14 层

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦 13、14 层

邮政编码：200001

法定代表人：陈敏

信息披露负责人：林志松

电话：95105686

传真：021-63410600

电子邮箱：[public@fullgoal.com.cn](mailto:public@fullgoal.com.cn)

(四) 基金托管人：中国工商银行股份有限公司（以下简称：中国工商银行）

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码：100032

法定代表人：姜建清

信息管理负责人：庄为

电话：010—66106912

传真：010—66106904

电子邮箱：custody@icbc.com.cn

(五) 本基金选用的信息披露报刊：中国证券报、上海证券报

登载半年度报告正文的管理人互联网网址：[www.fullgoal.com.cn](http://www.fullgoal.com.cn)

基金半年度报告置备地点：

富国基金管理有限公司 上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦  
13、14 层

中国工商银行 北京市西城区复兴门内大街 55 号

(六) 注册登记机构名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

## 二、主要财务指标和基金净值表现

### (一) 主要财务指标

序号	主要财务指标	本期间
1	基金本期净收益	113,899,890.26 元
2	加权平均基金份额本期净收益	27.23%
3	期末基金资产净值	522,283,200.89 元
4	期末可供分配基金收益	58,154,236.48 元
5	期末可供分配基金份额收益	0.1670 元
6	期末基金份额净值	1.5002 元
7	基金加权平均净值收益率	22.42%
8	本期基金份额净值增长率	63.13%
9	基金份额累计净值增长率	66.85%

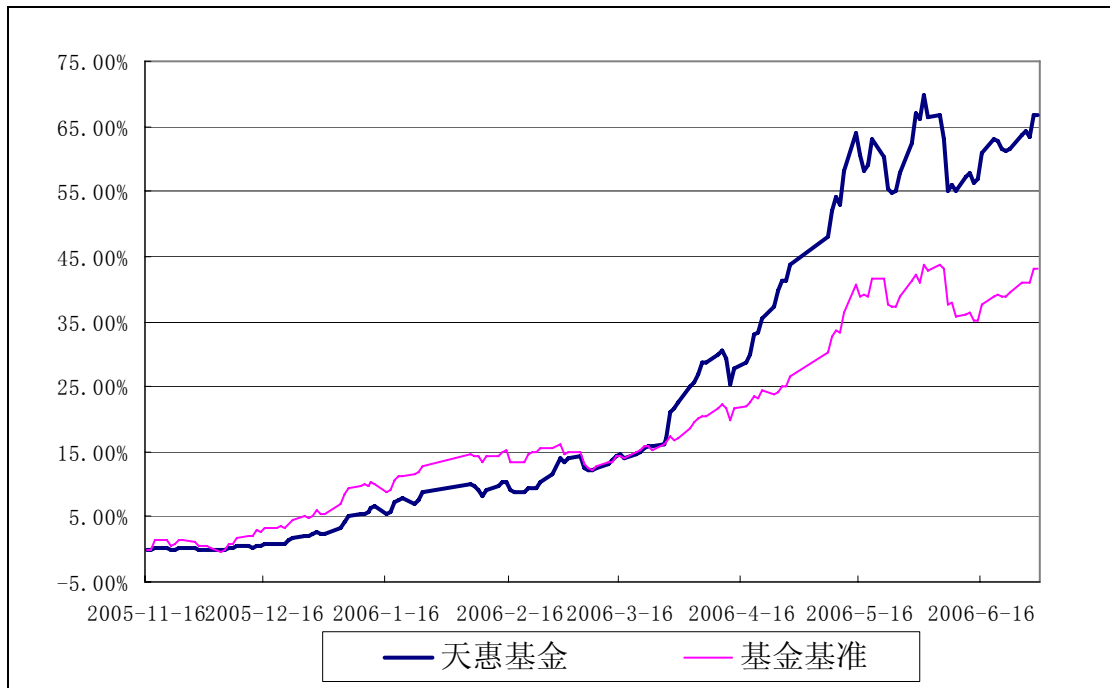
提示：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 基金净值表现

1、富国天惠精选成长混合型证券投资基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
过去一个月	0.36%	1.65%	1.51%	1.23%	-1.15%	0.42%
过去三个月	36.02%	1.71%	22.33%	1.20%	13.69%	0.51%
过去六个月	63.13%	1.34%	35.74%	0.98%	27.39%	0.36%
自基金成立起至今	66.85%	1.19%	43.26%	0.90%	23.59%	0.29%

2、自基金合同生效以来富国天惠精选成长混合型证券投资基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金自合同生效日至截止日不满 1 年，截止日期为 2006 年 6 月 30 日。

### 三、管理人报告

#### (一) 基金管理人及基金经理小组情况

##### 1、基金管理人

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行 (BMO) 参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截止 2006 年 6 月 30 日，本基金管理人管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、汉鼎证券投资基金、汉博证券投资基金四只封闭式证券投资基金和富国动态平衡证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金 (LOF) 和富国天时货币市场基金六只开放式证券投资基金。

##### 2、基金经理小组

朱少醒, 男, 生于 1973 年, 管理学博士, 八年证券从业经验。曾先后担任华夏证券研究所分析师、富国基金管理公司研究策划部分析师、富国基金管理公司产品开发主管, 2004 年 6 月至 2005 年 8 月任富国天益价值证券投资基金基金经理助理, 2005 年 11 月起任富国天惠精选成长基金基金经理。

#### (二) 遵规守信说明

本报告期, 富国基金管理有限公司作为富国天惠精选成长混合型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天惠精选成长混合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, 以在充分重视本金长期安全的前提下, 力争为基金持有人创造较高的当期收益为目标, 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) 对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明与解释

本基金在报告期内净值增长率 63.13%, 期间每 10 份基金份额派发红利 1.2 元。按照晨星分类, 报告期内本基金在 54 个可比基金中排名第 7。

在报告期内本基金实现了净值的稳定增长，取得了良好的投资业绩，并通过高额分红为持有人实现了较高的收益。

天惠基金上半年的运作经历了封闭期和开放期两个阶段。从年初到 2 月 16 日尚处于封闭运作期，考虑到开放初期基金份额的不稳定性及净值低波动的需求，基金经理采取了相对保守的仓位稳健运作。从 2 月 16 日开始，基金进入正常赎回期。基金在实现分红后逐步调整到正常仓位。基金净值的增长的动量也提升到正常水平。

在资产配置方面，本基金兼顾了行业趋势向好、估值合理的公司和行业趋势不确定性大但股价过度反应的公司，重点配置偏向于前者。具体行业配置方面，本基金在消费品、金融、商业、地产、电网设备投资、港口机械等行业进行超额配置，在电力、钢铁等行业低于基准配置。个股层面，本基金重点投资于管理层诚信、公司治理机构良好、未来几年能维持高质量增长的企业。我们认为选择具有良好“企业基因”、公司治理结构完善，并由高素质、值得信赖的管理层领导的企业，分享企业自身增长带来的资本市场收益是成长型基金取得收益的最佳途径。同时，在天惠上半年的运作中，人民币汇率制度改革、政府主导的投资拉动、城市化、产业结构升级等对市场有中长期影响的投资主题始终体现在天惠组合的构建和调整过程中。

#### （四）对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

对于下半年的 A 股市场我们有如下判断：

中国的经济将继续维持较高的增长速度。而在全世界经济走强的背景下，我国的外贸出口将继续保持较高的增速。外汇占款的居高不下导致市场在今后较长的一段时期内依然会有充裕的流动性。上半年的固定资产投资过快的增速势必引发对经济过热的担忧，不排除下半年继续有紧缩的措施出台。但在人民币汇率升值压力的背景下，货币政策的可供选择的空间并不是很大。就市场估值而言，经过上半年市场估值中枢的整体上移，就市场的整体估值水平已经趋于合理。对于一些概念股，甚至已有一定的泡沫成份。但我们认为，对于那些质地优良的上市公司，以合理的估值长期持有，投资者依然能分享到企业高速增长带来的良好收益。我们认为下半年的市场结构分化现象会较上半年明显，机会更多产生于个股选择层面。

## 四、托管人报告

2006年上半年，本托管人在对富国天惠精选成长混合型证券投资基金 (LOF)



的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

2006年上半年，富国天惠精选成长混合型证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国天惠精选成长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对富国基金管理有限公司在2006年上半年所编制和披露的富国天惠精选成长混合型证券投资基金半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2006年8月25日

## 五、财务会计报告（未经审计）

### （一）会计报告书

#### 1、2006年6月30日资产负债表

金额单位：人民币元

资 产	注释号	期末数	年初数
银行存款		11,020,082.55	4,361,001.50
清算备付金		1,437,004.46	6,141,906.36
交易保证金		544,689.99	48,780.49
应收证券清算款		3,069,019.27	718,864.05
应收股利			
应收利息		474,738.25	358,196.08
应收申购款		65,599.94	113,300.49
其他应收款			
股票投资市值		475,451,932.20	230,200,378.75

其中：股票投资成本	341,373,844.64	217,654,676.41
债券投资市值	35,831,500.00	27,224,628.30
其中：债券投资成本	33,719,348.68	26,502,111.22
权证投资市值		
其中：权证投资成本		
配股权证		
买入返售证券		330,000,000.00
待摊费用		
其他资产		
<b>资产合计</b>	<b>527,894,566.66</b>	<b>599,167,056.02</b>
负债及基金持有人权益		
应付证券清算款		
应付赎回款	3,431,709.83	
应付赎回费	13,923.01	
应付管理人报酬	675,723.58	750,890.39
应付托管费	112,620.60	125,148.39
应付佣金	670,903.45	181,092.87
应付利息		
应付收益		
未交税金		
其他应付款	537,881.99	
卖出回购证券款		
短期借款		
预提费用	168,603.31	
其他负债		
<b>负债合计</b>	<b>5,611,365.77</b>	<b>1,057,131.65</b>
基金持有人权益		
实收基金	348,136,011.40	584,787,112.09
未实现利得	115,992,953.01	13,276,345.01
未分配收益	58,154,236.48	46,467.27
<b>持有人权益合计</b>	<b>522,283,200.89</b>	<b>598,109,924.37</b>
<b>负债与持有人权益总计</b>	<b>527,894,566.66</b>	<b>599,167,056.02</b>

所附附注为本会计报表的组成部分

## 2、2006 年上半年度经营业绩表

金额单位：人民币元

项 目	注释号	本期数	上年同期数
一、收入		118,616,995.48	

1、股票差价收入	101,232,582.03
2、债券差价收入	1,864,312.48
3、权证差价收入	10,359,843.23
4、债券利息收入	158,627.24
5、存款利息收入	331,496.42
6、股利收入	3,448,793.68
7、买入返售证券收入	227,693.43
8、其他收入	993,646.97
<b>二、费用</b>	<b>4,717,105.22</b>
1、基金管理人报酬	3,851,006.90
2、基金托管费	641,834.49
3、卖出回购证券利息支出	17,205.48
4、利息支出	0.00
5、其他费用	207,058.35
其中：上市费	29,752.78
信息披露费	99,178.95
审计费用	39,671.58
<b>三、基金净收益</b>	<b>113,899,890.26</b>
加：未实现利得	122,922,019.46
<b>四、基金经营业绩</b>	<b>236,821,909.72</b>

所附附注为本会计报表的组成部分

### 3、2006 年上半年度基金收益分配表

金额单位：人民币元

项目	本期数	上年同期数
本期基金净收益	113,899,890.26	
加：期初基金净收益	46,467.27	
加：本期损益平准金	-8,428,912.30	
加：以前年度损益调整		
可供分配基金净收益	105,517,445.23	
减：本期已分配基金净收益	47,363,208.75	
期末基金净收益	58,154,236.48	

所附附注为本会计报表的组成部分

### 4、2006 年上半年度基金净值变动表

金额单位：人民币元

项目	本期数	上年同期数
一、期初基金净值	598,109,924.37	

## 二、本期经营活动:

基金净收益	113,899,890.26
未实现利得	122,922,019.46
经营活动产生的基金净值变动数	236,821,909.72

## 三、本期基金单位交易:

基金申购款	507,327,876.64
基金赎回款	772,613,301.09
基金单位交易产生的基金净值变动数	-265,285,424.45

## 四、本期向持有人分配收益:

向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	47,363,208.75
----------------------	---------------

## 五、期末基金净值

522,283,200.89

所附附注为本会计报表的组成部分

## (二) 会计报表附注

**1、 基金设立说明**

富国天惠精选成长混合型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会证监基金字[2005]268号文《关于富国天惠精选成长混合型证券投资基金 (LOF) 设立的批复》的批准, 由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行人募集并于2005年11月16日正式成立, 首次设立募集规模为584,312,553.76份基金份额。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

**2、 会计报表编制基础**

本基金的会计报表系按照《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》和《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》及基金合同的规定而编制。

**3、 主要会计政策**

(1) **会计年度:** 自公历1月1日至12月31日。本会计期间为2006年1月1日至2006年6月30日。

(2) **记帐本位币:** 人民币

(3) **记帐基础和计价原则:**

以权责发生制为记账基础，除上市股票和债券按市值计价外，其余均以历史成本为计价原则。

#### (4) 基金资产的估值原则

- A. 上市股票以估值日证券交易所挂牌的市场收盘价估值；该日无交易的，以最近交易日收盘价估值；
- B. 未上市的股票分两种情况处理：配股和增发新股，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；首次公开发行的股票，按成本估值；
- C. 配股权证，从配股除权日到配股确认日止，按市场收盘价高于配股价的差额估值；
- D. 上市债券以不含息价格计价，按估值日证券交易所挂牌的市场收盘价计算后的净价估值；该日无交易的，以最近交易日收盘价估值，并按债券面值与票面利率在债券持有期间内计提利息；
- E. 未上市债券以不含息价格计价，按成本估值，并按债券面值与票面利率在债券持有期间内逐日计提利息；
- F. 上市流通的权证以其估值日在证券交易所挂牌交易的市场收盘价估值；该日无交易的，以最近一个交易日的市场收盘价计算；
- G. 未上市流通的权证，由基金管理人和托管人综合考虑市场情况、标的股票价格、行权价格、剩余期限、市场无风险利率、标的股票价格波动等因素，按照最能反映权证公允价值的价格估值；
- H. 银行存款应计利息系按银行存款日余额从上一收息日逐日计息至估值日；
- I. 如有确凿证据表明按上述方法对基金进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；
- J. 估值对象为基金所拥有的股票、债券和银行存款等资产；
- K. 每个工作日均对基金资产进行估值；
- L. 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### (5) 证券投资的成本计价方法

按移动加权平均法计算库存证券的成本。当日同时有买入和卖出时，先计算买入成本后再计算买卖证券价差。

## A. 股票

上交所买入股票成本：由买入金额、买入印花税、买入过户费、买入经手费、买入证管费和买入佣金组成；

深交所买入股票成本：由买入金额、买入印花税、买入经手费和买入佣金组成；

上海股票的佣金是按买卖股票成交金额的1‰减去经手费和证管费计算。深圳股票的佣金是按买卖股票成交金额的1‰减经手费计算。

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款入帐；因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票差价收入/（损失），出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

## B. 债券

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入帐，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入帐，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入央行票据和零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

债券交易不计佣金。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/（损失）；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/（损失）。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

## C. 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资，权证投资成本按成交日应支付的全部价款入帐；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认权证差价收入/（损失），出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

D. 买入返售证券

通过证券交易所进行融券业务，按成交日扣除手续费后的应付金额确认买入返售证券投资；通过银行间市场进行融券业务，按实际支付的价款确认买入返售证券投资。

**(6) 待摊费用的摊销方法和摊销期限**

本科目核算已经发生的、影响基金单位净值小数点后第五位的费用，应分摊计入本期和以后各期的费用，如注册登记费、上市年费、信息披露费、审计费用和律师费用等。待摊费用按直线法在当期逐日摊销。

**(7) 收入的确认和计量**

- A. 股票差价收入于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账；
- B. 债券差价收入：
  - 卖出交易所上市债券——于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；
  - 卖出银行间市场交易债券——于实际收到价款时确认债券差价收入，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账；
- C. 权证差价收入于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账；
- D. 债券利息收入按实际持有期内逐日计提，并按债券票面价值与票面利率计提的金额入账；
- E. 存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
- F. 股利收入于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账；
- G. 买入返售证券收入按融出资金额及约定利率在回购期限内逐日计提的金额入账；
- H. 其他收入于实际收到时确认收入。

**(8) 费用的确认和计量**



基金费用包括管理人报酬、基金托管费、卖出回购证券支出、利息支出和其他费用。

- A. 管理人报酬和基金托管费按照基金合同和招募说明书规定的方法和标准计提，并按计提的金额入帐。
- B. 卖出回购证券支出在该证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入帐。
- C. 利息支出在借款期内逐日计提，按借款本金与适用的利率计提的金额入帐。
- D. 除上述基金费用以外的其他各项费用，如注册登记费、上市年费、信息披露费、审计费用和律师费用等，如果影响计算日基金净值小数点后第五位的，采取待摊和预提的方法，否则发生时作为基金费用一次计入基金损益。待摊或预提计入基金费用数额的多少，以不影响计算日基金净值小数点后第五位为准。

#### (9) 实收基金

每份基金份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的基金份额总额。

#### (10) 基金的收益分配政策

- A. 每一基金单位享有同等分配权；
- B. 基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
- C. 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- D. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满3个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成；
- E. 本基金收益分配采用现金形式。基金管理人为持有人提供红利再投资服务。投资者选择红利再投资服务的，其分红资金按除息日的基金单位净值转成相应的基金单位；
- F. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### (11) 税项

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作的规定，主要税项为：

- A. 印花税



基金管理人运用基金买卖股票2005年1月24日前按照2%的税率征收印花税，2005年1月24日后按1%征收印花税。

#### B. 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围，不征收营业税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

#### C. 个人所得税

对基金取得的债券利息收入及储蓄利息收入，由债券发行企业和银行在向基金派发债券利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

对基金在2005年6月13日前取得股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴20%的个人所得税；对基金在2005年6月13日后取得股票的股息、红利收入，根据财税[2005]102号文通知，暂减按50%计算应纳税所得额，即上市公司在向基金派发股息、红利收入时按10%代扣代缴个人所得税。

(12) 本报告期没有发生重大会计差错。

### 4、 关联方关系及其交易

#### (1) 关联方关系

企业名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
海通证券股份有限公司	基金管理人的股东
申银万国证券股份有限公司	基金管理人的股东
山东省国际信托投资公司	基金管理人的股东
加拿大蒙特利尔银行	基金管理人的股东

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### (2) 关联方交易

本基金在本报告期与关联方进行的关联交易是在正常业务中按照一般商业条款而订立的，关联交易是按照市场公允价进行定价。

#### A 通过关联方席位进行的交易

关联方名称 \_\_\_\_\_ 2006 年上半年 \_\_\_\_\_ 2005 年上半年 \_\_\_\_\_

股票买卖	成交金额	占本期总交易金额的比例 (%)	成交金额	占2005年上半年总交易金额的比例 (%)
申银万国	560,704,021.97	31.44		
海通证券	496,771,002.55	27.85		
债券买卖	成交金额	占本期交易金额的比例 (%)	成交金额	占2005年上半年交易金额的比例 (%)
申银万国	54,750,666.20	46.04		
海通证券	41,176,504.60	34.63		
权证买卖	成交金额	占本期交易金额的比例 (%)	成交金额	占2005年上半年交易金额的比例 (%)
申银万国	9,570,509.74	92.37		
海通证券	493,956.07	4.77		
证券回购	成交金额	占本期交易金额的比例 (%)	成交金额	占2005年上半年交易金额的比例 (%)
申银万国	100,000,000.00	66.67		
海通证券				
佣金	佣金	占本期佣金总量的比例 (%)	佣金	占2005年上半年佣金总量的比例 (%)
申银万国	458,774.02	31.84		
海通证券	403,668.52	28.01		

注：1) 上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。

2) 股票交易佣金为成交金额的 1%扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费和证券结算风险基金等）；证券公司不向本基金收取国债现货及国债回购和企业债券的交易佣金，但交易的经手费和证管费由本基金交纳，其所计提的证券结算风险基金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金的比率是公允的，符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## B 关联方报酬

### ◆ 基金管理人报酬——基金管理费

- 基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

- 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

	期初余额	本期计提	本期支付	本期余额
2006 上半年度	750,890.39	3,851,006.90	3,926,173.71	675,723.58
2005 上半年度				

### ◆ 基金托管人报酬——基金托管费

- 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

- 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。

	期初余额	本期计提	本期支付	本期余额
2006 上半年度	125,148.39	641,834.49	654,362.28	112,620.60
2005 上半年度				

## C 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易：

➤ 与托管行进行银行间同业市场债券交易明细如下：

债券交易	成交金额（元）	利息收入（元）	利息支出
2006年上半年			
2005年上半年			

注：本基金本期及2005年上半年与托管行未进行银行间同业市场的债券交易。

➤ 与托管行进行银行间同业市场融资（回购）业务交易明细如下：

融资（回购）交易	成交金额（元）	利息收入（元）	利息支出
2006年上半年			
2005年上半年			

注：本基金本期及2005年上半年与基金托管人未进行银行间同业市场融资（回购）交易业务。

#### D 由关联方保存的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。

由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息明细如下：

年份	银行存款余额（元）	银行存款利息收入（元）
2006年上半年	11,020,082.55	302,425.23
2005年上半年		

#### E 关联方持有基金份额

基金管理人所持有的本基金份额

2006年上半年末及2005年上半年末本基金的基金管理人均未持有本基金份额。

基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额

2006年上半年末及2005年上半年末本基金的基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构于均未持有本基金份额。

### 5、会计报表主要项目注释

#### (1) 银行存款

项 目	金 额（元）
活期存款	11,020,082.55

注：本基金2006年上半年未投资于定期存款。

**(2) 应收利息**

项 目	金 额 (元)
银行存款利息	6,004.91
清算备付金利息	582.03
权证保证金利息	19.80
债券利息	468,131.51
返售证券利息	
合 计	474,738.25

**(3) 其他应收款**

注：本基金本期末无其他应收款余额。

**(4) 待摊费用**

注：本基金待摊费用无期末结存余额。

**(5) 投资估值增值**

项目	2006-06-30		
	成本(元)	市值(元)	估值增值(元)
股票投资	341,373,844.64	475,451,932.20	134,078,087.56
债券投资	33,719,348.68	35,831,500.00	2,112,151.32
权证投资			

注：2006年1月1日至2006年6月30日本基金所投资的股票中，因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价额人民币2,393,927.60元。此等现金对价于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

**(6) 应付佣金**

项 目	金 额 (元)
海通证券	212,882.01
申银万国	248,204.89
银河证券	182,209.11
华西证券	27,607.44
合 计	670,903.45

**(7) 应付利息**

注：本基金本期末无应付利息余额。

**(8) 其他应付款**

项 目	金 额 (元)
应付席位保证金	500,000.00
应付后端申购费	13,381.99
其他	24,500.00
合 计	537,881.99

**(9) 预提费用**

项 目	金 额 (元)
审计费	39,671.58
信息披露费	99,178.95
上市年费	29,752.78
合 计	168,603.31

**(10) 实收基金**

期初数 (份)	本期因申购的增 加数 (份)	本期因赎回的减少 数 (份)	期末数 (份)
584,787,112.09	419,101,861.28	655,752,961.97	348,136,011.40

**(11) 未实现利得**

项 目	金 额 (元)
股票投资估值增值	134,078,087.56
债券投资估值增值	2,112,151.32
权证投资估值增值	
本期申购的未实现利得平准金	70,372,330.89
本期赎回的未实现利得平准金	-90,569,616.76
未实现利得一权证	
合 计	115,992,953.01

注：未实现利得包括本基金于2006年06月30日对各项资产进行估值时，各项资产估值额与帐面成本之差额，以及申购赎回过程中所产生的未实现利得平准金。

**(12) 股票差价收入**

项 目	2006年度上半年 (金额：元)
卖出股票成交总额	888,983,938.27
卖出股票成本总额	787,004,363.17
股票差价收入	101,232,582.03

**(13) 债券差价收入**

项 目	2006年度上半年 (金额：元)
卖出债券成交总额	58,278,479.79
卖出债券成本总额	56,124,177.63
卖出债券应收利息总额	289,989.68
债券差价收入	1,864,312.48

**(14) 权证差价收入**

项 目	2006年度上半年 (金额：元)
卖出权证成交总额	10,359,843.23
卖出权证成本总额	
权证差价收入	10,359,843.23

**(15) 其他收入**

项 目	2006年度上半年 (金额: 元)
赎回费	993,646.97
配股手续费返还	
新股手续费返还	
其他	
合 计	993,646.97

**(16) 其他费用**

项 目	2006年度上半年 (金额: 元)
债券账户维护费	6,000.00
信息披露费	99,178.95
审计费用	39,671.58
交易所回购手续费	812.54
交易所费用	30,000.00
上市年费	29,752.78
银行电汇费	1,142.50
银行间交易费用	500.00
合 计	207,058.35

**(17) 本期已分配基金净收益**

2006年度上半年本基金收益分配情况如下:

	分红预告日	权益登记日	每10份基金份额收益分配金额 (元)	收益分配金额 (元)
本年度第 1 次分红	2006-2-15	2006-2-17	0.40	19,820,868.09
本年度第 2 次分红	2006-3-22	2006-3-24	0.30	8,224,471.67
本年度第 3 次分红	2006-4-8	2006-4-12	0.50	19,317,868.99
累计收益分配金额			1.20	47,363,208.75

**(18) 期末流通受限的基金资产**

截至2006年6月30日, 本基金其他原因流通受限制的基金资产明细如下:

股票名称	申购确定日	上市日期	可流通日	数量 (股)	总成本 (元)	总市值 (元)	受限原因	估值方法
大同煤业	2006-06-12	2006-06-23	2006-09-25	43,835	296,324.60	447,993.70	新股网下中签锁定期未上市	市价
中国银行	2006-06-28	2006-07-05	2006-07-05	126,000	388,080.00	388,080.00	新股未上市	成本价

截止2006年6月30日, 因股权分置改革暂时停牌的基金资产明细如下:

股票代码	股票名称	数量 (股)	投资成本 (元)	期末估值单价 (元)	期末估值总额 (元)	停牌日期	复牌日期	复牌开盘单价 (元)
------	------	--------	----------	------------	------------	------	------	------------

000895	双汇发展	722,030	10,816,642.62	31.17	22,505,675.10	2006-06-01	待定	待定
600383	金地集团	463,380	3,743,568.51	8.57	3,971,166.60	2006-3-27	2006-7-11	9.43
600315	上海家化	1,028,305	12,541,756.51	16.98	17,460,618.90	2006-6-14	2006-7-24	13.73
600415	小商品城	260,000	9,793,564.65	63.27	16,450,200.00	2006-6-19	2006-7-4	57.05

## 6、或有事项

无需要说明的重大或有事项。

## 7、承诺事项

无需要说明的承诺事项。

## 8、资产负债表日后的非调整事项

无需要说明的资产负债表日后的非调整事项。

## 9、其他重要事项

无需要说明的其他重要事项。

# 六、投资组合报告（2006年6月30日）

## （一）基金资产组合情况

截至 2006 年 6 月 30 日，富国天惠精选成长混合型证券投资基金 (LOF) 资产净值为 522,283,200.89 元，基金份额净值为 1.5002 元，基金份额累计净值为 1.6202 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	475,451,932.20	90.07
2	债券	35,831,500.00	6.79
3	银行存款及清算备付金	12,457,087.01	2.36
4	权证		
5	其他资产	4,154,047.45	0.78
	合计	527,894,566.66	100

## （二）按行业分类的股票投资组合

序号	分类	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	18,206,118.70	3.49



3	C 制造业	267,143,176.74	51.15
	C0 食品、饮料	78,537,536.30	15.04
	C1 纺织、服装、皮毛	5,912,400.00	1.13
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷	8,083,529.58	1.55
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	36,632,693.70	7.01
	C5 电子	7,730,142.68	1.48
	C6 金属、非金属	33,887,764.80	6.49
	C7 机械、设备、仪表	81,993,243.73	15.70
	C8 医药、生物制品	14,365,865.95	2.75
	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	26,585,515.84	5.09
7	G 信息技术业	34,056,605.15	6.52
8	H 批发和零售贸易	47,705,174.48	9.13
9	I 金融、保险业	40,655,409.09	7.78
10	J 房地产业	21,867,732.20	4.19
11	K 社会服务业	1,151,000.00	0.22
12	L 传播与文化产业	1,631,000.00	0.31
13	M 综合类	16,450,200.00	3.15
	合 计	475,451,932.20	91.03

### (三) 报告期末股票投资明细

序号	证券代码	证券名称	证券库存数量 (股)	证券市值(元)	市值占基金净值(%)
1	600519	G 茅 台	863905	40,983,653.20	7.85
2	600320	G 振 华	1361621	26,878,398.54	5.15
3	600036	G 招 行	3312079	25,536,129.09	4.89
4	000400	G 许 继	3135331	23,483,629.19	4.50
5	000895	双汇发展	722030	22,505,675.10	4.31
6	600009	G 沪机场	1458188	21,012,489.08	4.02
7	002024	苏宁电器	393039	20,123,596.80	3.85
8	000402	G 金融街	2182508	17,896,565.60	3.43
9	600315	上海家化	1028305	17,460,618.90	3.34
10	000927	一汽夏利	2600000	16,952,000.00	3.25
11	600415	小商品城	260000	16,450,200.00	3.15
12	600406	国电南瑞	586239	16,051,223.82	3.07
13	600694	大商股份	381814	15,788,008.90	3.02

14	000039	G 中 集	969972	15,616,549.20	2.99
15	600030	G 中 信	930000	14,731,200.00	2.82
16	600312	G 平 高	1223268	14,679,216.00	2.81
17	000538	G 云白药	482631	13,972,167.45	2.68
18	600660	G 福 耀	1568130	12,733,215.60	2.44
19	600309	G 万 华	837440	12,142,880.00	2.32
20	600028	中国石化	1697300	10,608,125.00	2.03
21	600271	G 航 信	338124	10,147,101.24	1.94
22	600887	G 伊 利	435200	9,918,208.00	1.90
23	600963	G 岳 纸	1192261	8,083,529.58	1.55
24	000063	G 中 兴	274669	7,858,280.09	1.50
25	600563	G 法 拉	781612	7,730,142.68	1.48
26	600123	G 兰 花	550000	7,150,000.00	1.37
27	600628	G 新世界	723276	6,357,596.04	1.22
28	600439	G 瑞贝卡	520000	5,912,400.00	1.13
29	600269	G 赣 粤	567518	5,573,026.76	1.07
30	600631	G 百 联	676958	5,435,972.74	1.04
31	000792	G 钾 肥	262916	5,337,194.80	1.02
32	000729	G 燕 啤	600000	5,130,000.00	0.98
33	600383	金地集团	463380	3,971,166.60	0.76
34	600549	G 厦 钨	200000	3,062,000.00	0.59
35	000970	G 三 环	200000	2,476,000.00	0.47
36	600331	G 宏 达	100000	1,692,000.00	0.32
37	600831	G 广 电	100000	1,631,000.00	0.31
38	000069	G 华侨城	100000	1,151,000.00	0.22
39	601001	大同煤业	43835	447,993.70	0.09
40	600085	G 同仁堂	24050	393,698.50	0.08
41	601988	中国银行	126000	388,080.00	0.07

#### (四) 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 1、报告期内累计买入价值占期初基金资产净值的比例超过 2%的股票明细：

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额 (元)	占期初基金资产净值的比例 (%)
1	600030	G 中 信	46,304,526.58	7.74
2	600009	G 沪机场	45,056,522.11	7.53
3	600028	中国石化	37,887,157.82	6.33
4	000400	G 许 继	34,821,494.60	5.82
5	000069	G 华侨城	34,506,949.15	5.77
6	600320	G 振 华	33,995,435.96	5.68

7	002024	苏宁电器	31,518,391.34	5.27
8	000927	一汽夏利	26,778,568.11	4.48
9	600000	G 浦 发	25,962,772.05	4.34
10	000002	G 万科 A	25,291,412.97	4.23
11	600549	G 厦 钨	22,685,151.78	3.79
12	000402	G 金融街	21,885,042.05	3.66
13	600519	G 茅 台	21,756,750.36	3.64
14	600036	G 招 行	21,571,485.05	3.61
15	600694	大商股份	20,033,094.72	3.35
16	600415	小商品城	18,811,188.27	3.15
17	600563	G 法 拉	16,813,879.85	2.81
18	000060	G 中 金	16,222,833.08	2.71
19	000063	G 中 兴	15,792,383.51	2.64
20	600406	国电南瑞	15,442,042.46	2.58
21	600331	G 宏 达	14,990,121.71	2.51
22	000039	G 中 集	14,935,705.96	2.50
23	600628	G 新世界	14,908,953.99	2.49
24	600312	G 平 高	14,831,326.41	2.48
25	600963	G 岳 纸	14,824,365.62	2.48
26	600688	上海石化	14,450,823.49	2.42
27	600315	上海家化	14,212,289.32	2.38
28	600895	G 张 江	13,673,999.32	2.29
29	600636	G 三爱富	13,311,724.43	2.23
30	600037	G 歌 华	12,967,530.10	2.17
31	600123	G 兰 花	12,843,408.87	2.15
32	000729	G 燕 啤	12,721,848.16	2.13

2、报告期内累计卖出价值占期初基金资产净值的比例超过 2%的股票明细:

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额 (元)	占期初基金资产净值的比例 (%)
1	600030	G 中 信	49,358,363.39	8.25
2	600320	G 振 华	42,608,940.43	7.12
3	600549	G 厦 钨	38,946,522.15	6.51
4	000069	G 华侨城	37,006,391.32	6.19
5	600000	G 浦 发	34,111,071.84	5.70
6	600009	G 沪机场	32,294,576.20	5.40
7	002024	苏宁电器	31,338,224.86	5.24
8	600028	中国石化	27,591,135.67	4.61
9	600563	G 法 拉	24,133,964.09	4.04
10	000060	G 中 金	23,516,483.29	3.93
11	000002	G 万科 A	23,285,439.58	3.89

12	000402	G 金融街	21,850,244.15	3.65
13	600312	G 平 高	21,075,137.15	3.52
14	600418	G 江 汽	20,491,510.17	3.43
15	600415	小商品城	18,550,768.18	3.10
16	600519	G 茅 台	18,350,755.81	3.07
17	600050	G 联 通	16,633,389.60	2.78
18	600694	大商股份	16,443,214.52	2.75
19	000927	一汽夏利	16,269,777.92	2.72
20	600688	上海石化	15,895,685.68	2.66
21	000400	G 许 继	14,831,584.48	2.48
22	600628	G 新世界	14,330,748.14	2.40
23	600895	G 张 江	14,111,109.34	2.36
24	600037	G 歌 华	13,785,121.06	2.30
25	600036	G 招 行	13,298,001.62	2.22
26	000538	G 云白药	13,029,940.70	2.18
27	600406	国电南瑞	12,781,115.87	2.14
28	000895	双汇发展	12,472,972.41	2.09
29	600636	G 三爱富	12,239,020.14	2.05

- 3、报告期内买入股票的成本总额为 913,117,459.00 元（其中未包含因股权分置改革获得的现金对价冲减股票成本金额 2,393,927.60 元）；  
 报告期内卖出股票的收入总额为 888,983,938.27 元。

（五）报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	券种	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债		
2	金融债	20,088,000.00	3.85
3	可转债	15,743,500.00	3.01
	合计	35,831,500.00	6.86

（六）报告期末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 29	20,088,000.00	3.85
2	南山转债	15,743,500.00	3.01
3			
4			
5			

### (七) 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备选股票库之外的股票。

3、截至 2006 年 6 月 30 日，本基金的其他资产项目包括：

序号	其他资产项目	金额 (元)
1	交易保证金	544,689.99
2	应收利息	474,738.25
3	应收证券交易清算款	3,069,019.27
4	其他应收款	
5	应收申购款	65,599.94
其他资产项目合计		4,154,047.45

4、截至 2006 年 6 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	110219	南山转债	15,743,500.00	3.01
合计			15,743,500.00	3.01

5、截至 2006 年 6 月 30 日，本基金曾持有权证证明细如下：

标的证券	权证代码	权证名称	持有原因	持有数量 (份)	成本总额 (元)	期末数量 (份)
G 沪机场	580996	沪场 JTP1 认沽权证	股改被动	1,430,298.00	0.00	0.00
G 招行	580997	招行 CMP1 认沽权证	股改被动	1,447,127.00	0.00	0.00
G 万华	580005	万华 HXB1 认购权证	股改被动	103,133.00	0.00	0.00
G 万华	580993	万华 HXP1 认沽权证	股改被动	154,700.00	0.00	0.00
G 茅台	580990	茅台 JCP1 认沽权证	股改被动	1,586,150.00	0.00	0.00
G 长电	580007	长电 CWB1 认购权证	股改被动	1,500.00	0.00	0.00
G 钾肥	038008	钾肥 JTP1 认沽权证	股改被动	93,898.00	0.00	0.00

注：本基金本期末未持有权证。

## 七、基金份额持有人户数、持有人结构

报告期末基金 份额持有 人户数	平均每户 持有基金份额	机构投资者持有 的基金份额	机构投资者 持有的基金 份额比例	个人投资者持有 的基金份额	个人投资者 持有的基金 份额比例
-----------------------	----------------	------------------	------------------------	------------------	------------------------

2,378	146,398.66	271,072,735.90	77.86%	77,063,275.50	22.14%
-------	------------	----------------	--------	---------------	--------

## 八、基金份额变动

基金合同生效日基金 份额总额	期初基金 份额总额	期末基金 份额总额	报告期内基金 总申购份额	报告期内基金 总赎回份额
584,312,553.76	584,787,112.09	348,136,011.40	419,101,861.28	655,752,961.97

## 九、重大事件揭示

- 1、本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。
- 2、本报告期本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。
- 3、本报告期内，无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。
- 4、本报告期本基金投资策略无改变。
- 5、2006年上半年本基金收益分配情况如下：

	分红预告日	权益登记日	每10份基金份 额收益分配金 额(元)	收益分配金额 (元)
本年度第1次分红	2006-2-15	2006-2-17	0.40	19,820,868.09
本年度第2次分红	2006-3-22	2006-3-24	0.30	8,224,471.67
本年度第3次分红	2006-4-8	2006-4-12	0.50	19,317,868.99
累计收益分配金额			1.20	47,363,208.75

本公司在中国证券报和公司网站上对上述分红事宜进行公告。

- 6、本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。
- 7、本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。
- 8、根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基字[1998]29号)中关于“每只基金通过一个证券经营机构买卖证券的年成交量，不得超过该基金买卖证券年成交量的30%”的要求，根据证券经营机构提供的报告质量、报告数量、服务态度、课题委托效果及数量，富国天惠基金共选择4家证券经营机构租用了基金专用交易席位。有关专用交易席位2006年上半年度的交易情况见下表：

券商名称	席位 数量	成交量(人民币元)				佣金 (人民币元)
		股票	债券	回购	权证	

申银万国	1	560,704,021.97	54,750,666.20	100,000,000.00	9,570,509.74	458,774.02
海通证券	2	496,771,002.55	41,176,504.60		493,956.07	403,668.52
华西证券	1	291,431,738.49	11,090,481.60	50,000,000.00		238,472.66
银河证券	1	434,613,956.22	11,900,000.00		296,186.89	340,089.24
<b>合计</b>		1,783,520,719.23	118,917,652.40	150,000,000.00	10,360,652.70	1,441,004.44

交易席位	成交量占比				佣金占总佣金比例
	股票交易量占股票总交易量的比例	债券交易量占债券总交易量的比例	回购交易量占回购总交易量的比例	权证交易量占权证总交易量的比例	
申银万国	31.44%	46.04%	66.67%	92.37%	31.84%
海通证券	27.85%	34.63%		4.77%	28.01%
华西证券	16.34%	9.33%	33.33%		16.55%
银河证券	24.37%	10.01%		2.86%	23.60%
<b>合计</b>	100%	100%	100%	100.00%	100%

注：上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。我对基金交易席位的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

本期租用席位的变更情况：本基金本期租用席位无变更。

9、本公司于2006年2月7日起开通本基金网上交易业务，并于2006年2月6日在中国证券报、上海证券报和公司网站发布了《富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)开通网上交易业务的公告》。

10、本公司于2006年2月16日开放本基金场外赎回、场内申购和赎回业务，并于2006年2月13日在中国证券报、上海证券报和本公司网站上发布了《富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)开放场外赎回、场内申购和赎回的公告》。本基金于2006年2月16日开始在深圳证券交易所上市交易，并于2006年2月16日在中国证券报、上海证券报和本公司网站上发布了《富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)上市交易提示性公告》。

11、本公司于2006年4月8日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站发布了《富国基金管理有限公司关于开通全国统一客户服务号码的公告》，开通全国统一客户服务号码95105686（免长途话费）。

12、本公司于2006年5月26日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站发布了《富国基金管理有限公司增加华泰证券有限责任公司等为开放

式基金代销机构的公告》增加华泰证券有限责任公司为本基金的代销机构。

## 十、备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国天惠精选成长混合型证券投资基金的文件
- 2、富国天惠精选成长混合型证券投资基金基金合同
- 3、富国天惠精选成长混合型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、富国天惠精选成长混合型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

存放地点：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦 13、14 层

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

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

富国基金管理有限公司  
二 00 六年八月二十九日