

汉兴证券投资基金  
2011年第3季度报告

2011年09月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2011年10月26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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 10 月 24 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 2011 年 7 月 1 日起至 2011 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国汉兴封闭
基金主代码	500015
交易代码	500015
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年12月30日
报告期末基金份额总额（单位：份）	3,000,000,000.00
投资目标	本基金为平衡型证券投资基金，兼顾稳定收益和资本利得。即在投资于绩优型上市公司和债券的同时，兼顾成长型上市公司的投资，充分注重投资组合的流动性，从而为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全，谋求基金资产的长期稳定收益。
投资策略	坚持长期投资的同时加强波段操作，注重投资组合的长、中、短线相结合，适度投资、分散风险；根据行业研究的成果，在个股投资上注重挖掘个股价值和成长性，精选个股，强调组合的成长和价值的平衡。
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	交通银行股份有限公司

## § 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（2011年07月01日-2011年09月30日）
1. 本期已实现收益	25,990,605.76
2. 本期利润	-331,373,203.34
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1105
4. 期末基金资产净值	2,846,886,840.34
5. 期末基金份额净值	0.9490

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	-10.42%	1.84%	-	-	-	-

注：过去三个月指 2011 年 7 月 1 日—2011 年 9 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 2011 年 9 月 30 日。由于基金汉兴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 12 月 30 日成立，建仓期 6 个月，从 1999 年 12 月 30 日至 2000 年 6 月 29 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		
朱杰	本基金基金经理	2011-01-20	—	7年	硕士，曾任上海重型机器厂产品研发助理工程师；太平洋财产保险股份有限公司风险管理工程师；平安证券有限公司行业研究员；长信基金管理有限公司行业研究员；2007年7月至2011年1月任富国基金管理有限公司研究员；自2011年1月起任汉兴证券投资基金基金经理。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兴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》、《汉兴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

进入 3 季度以来，宏观经济不确定性明显加大，尤其是欧债危机加重了市场对经济前景的担忧，市场延续低迷走势。本基金采取以下投资策略：

随着外部环境不断恶化，中国经济转型的短期阵痛将逐步显现，固定资产投资高速增长难以为继，相关行业景气回落的风险加大。本基金已规避了对房地产、基建等传统重点投资领域的行业配置，相反，加大了新兴重点投资领域的资产配置，尤其是对节能环保板块实现了超配。

随着政府和市场力量引导社会财富分配日趋均衡化，消费群体扩大和购买力提升有可能引发一轮消费繁荣，中高端和品牌消费品行业有望实现持续快速增长。本基金加大了大消费行业配置。

另外，技术类公司的兴旺发达是中国经济崛起的关键，部分上市公司已初步具备成为全球行业龙头的基本条件。本基金将依据自下而上策略寻找工业技术领域的优质成长股。

总体上，本基金将坚持以低估值蓝筹股配置为主，适度配置优质成长股的策略。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金净值增长率为-10.42%。

## § 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	2,205,409,744.33	76.86
	其中：股票	2,205,409,744.33	76.86
2	固定收益投资	578,741,278.90	20.17
	其中：债券	578,741,278.90	20.17
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	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	75,221,569.78	2.62

6	其他资产	9,868,770.02	0.34
7	合计	2,869,241,363.03	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	—	—
C	制造业	1,216,662,703.14	42.74
C0	食品、饮料	128,514,428.16	4.51
C1	纺织、服装、皮毛	12,830,915.50	0.45
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	214,551,897.33	7.54
C5	电子	50,938,681.32	1.79
C6	金属、非金属	180,396,871.12	6.34
C7	机械、设备、仪表	576,128,391.01	20.24
C8	医药、生物制品	53,301,518.70	1.87
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	71,331,696.60	2.51
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	165,608,838.39	5.82
H	批发和零售贸易	326,207,838.42	11.46
I	金融、保险业	411,003,340.18	14.44
J	房地产业	—	—
K	社会服务业	14,595,327.60	0.51
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	2,205,409,744.33	77.47

## 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	600660	福耀玻璃	19,142,353	173,046,871.12	6.08
2	002269	美邦服饰	6,088,408	165,726,465.76	5.82
3	000001	深发展A	10,061,572	161,387,614.88	5.67
4	601299	中国北车	33,342,554	150,708,344.08	5.29
5	000887	中鼎股份	11,698,843	132,430,902.76	4.65
6	600036	招商银行	11,383,369	125,900,061.14	4.42
7	600016	民生银行	22,412,258	123,715,664.16	4.35
8	300146	汤臣倍健	1,456,758	99,015,841.26	3.48
9	000651	格力电器	4,511,839	90,191,661.61	3.17
10	600694	大商股份	1,803,404	72,496,840.80	2.55

#### 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	214,878,078.90	7.55
2	央行票据	—	—
3	金融债券	363,863,200.00	12.78
	其中：政策性金融债	363,863,200.00	12.78
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	578,741,278.90	20.33

#### 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	080221	08国开21	1,000,000	99,750,000.00	3.50
2	010203	02国债(3)	719,230	72,102,807.50	2.53
3	010112	21国债(12)	639,730	64,088,151.40	2.25
4	110315	11进出15	500,000	49,955,000.00	1.75
5	110233	11国开33	500,000	48,905,000.00	1.72

#### 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基金合同规定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	1,540,324.03
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	8,079,047.86
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	249,398.13
8	其他	—
9	合计	9,868,770.02

### 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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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（%）	0.33

## § 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兴基金的文件
- 2、汉兴证券投资基金基金合同
- 3、汉兴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、汉兴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

上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 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

2011 年 10 月 26 日