

汉兴证券投资基金  
二〇一四年半年度报告

2014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： 交通银行股份有限公司

送出日期： 2014年08月28日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人交通银行股份有限公司（简称：交通银行）根据本基金合同规定，于2014年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
§4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
§5	托管人报告.....	11
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6	半年度财务报表(未经审计).....	11
6.1	资产负债表.....	11
6.2	利润表.....	12
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	13
6.4	报表附注.....	14
§7	投资组合报告.....	29
7.1	期末基金资产组合情况.....	29
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	34
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	34
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	34
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	34
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	34
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	34

7.12	投资组合报告附注.....	35
§8	基金份额持有人信息.....	35
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	36
§9	开放式基金份额变动.....	36
§10	重大事件揭示.....	36
10.1	基金份额持有人大会决议.....	36
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	36
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4	基金投资策略的改变.....	37
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	37
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	38
10.8	其他重大事件.....	39
§11	备查文件目录.....	39

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汉兴证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2000年1月10日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	王涛
	联系电话	021-20361818	95559
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	t_wang@bankcomm.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95559
传真		021-20361616	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		200120	200120

法定代表人	陈敏	牛锡明
-------	----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 8 号 上海国金中心二期 16-17 层交通银行 上海市浦东新区 银城中路 188 号 上海证券交易所 上海市浦东南路 528 号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 上海分公司	上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号 中国保险大厦 36 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年01月01日至2014年06月30日)
本期已实现收益	-75,703,881.83
本期利润	-104,636,432.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0349
本期加权平均净值利润率	-3.52%
本期基金份额净值增长率	-3.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年06月30日)
期末可供分配利润	-107,385,161.41
期末可供分配基金份额利润	-0.0358
期末基金资产净值	2,947,065,515.83
期末基金份额净值	0.9824
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年06月30日)
基金份额累计净值增长率	160.24%

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，封闭式基金的交易佣金等），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。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

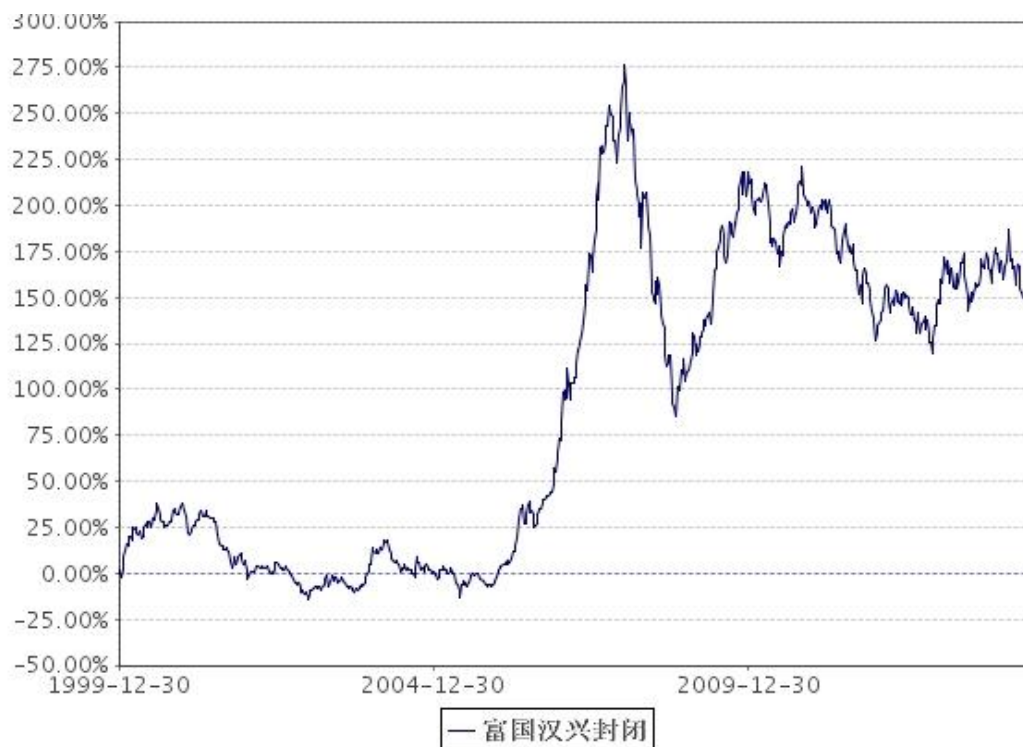
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	2.29%	1.82%	—	—	—	—
过去三个月	1.54%	1.96%	—	—	—	—
过去六个月	-3.42%	2.29%	—	—	—	—
过去一年	7.24%	2.05%	—	—	—	—
过去三年	-7.27%	2.17%	—	—	—	—
自基金合同生效日起至今	160.24%	2.45%	—	—	—	—

注：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，此表只列示基金的净值表现。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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2014年6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 基金管理人及基金经理

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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。截至2014年6月30日，本基金管理人共管理汉兴证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、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）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国汇利回报分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业股票型证券投资基金、富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强收益定期开放债券型证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国信用增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业股票型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国收益宝货币市场基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金四十七只证券投资基金。

#### 4.1.2 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		
戴益强	本基金基金经理 兼任富国医疗保健	2014-01-13	—	8年	硕士，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员；2008年9月至2012年10月任富国基金管理有限公司行业研究员，2012年10月至



	行业股票型证券投资基金基金经理				2014年1月任汉盛证券投资基金基金经理，2013年8月起任富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理，2014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。
刘魁	本基金前任基金经理	2012-05-16	2014-01-29	9年	博士，曾任嘉实基金管理有限公司研究员；诺安基金管理有限公司投资经理；自2010年4月至2012年3月任富国基金管理有限公司基金经理助理、专户投资经理，2012年5月至2014年1月任汉兴证券投资基金基金经理。

注：上述表格内基金经理的任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期根据公司决定确定的解聘日期。

证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和

反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，监察稽核部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

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，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 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。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现7次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

#### **4.4 管理人对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**

14年上半年宏观经济运行平稳，政策导向偏向于保底线和调结构，资本市场运行也基本符合平稳中调整的特征。本基金上半年根据经济和市场变化调整了仓位，阶段性配置了较多的医药、环保、建筑装饰等行业。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至2014年6月30日，本基金份额净值为0.9824元，份额累计净值为2.5210元。报告期内，本基金份额净值增长率为-3.42%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望下半年，本基金认为经济继续均衡调整的概率偏大，市场利率趋于缓慢下行，政策环境偏暖，有利于风险偏好的上升。本基金将保持较高仓位运作，积极寻找受益于转型期的行业，同时也将继续自下而上进行成长股的甄别工作，希望为持有人获得更好的收益。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末未进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2014 年上半年度，基金托管人在汉兴证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2014 年上半年度，富国基金管理有限公司在汉兴证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本报告期内本基金未进行收益分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2014 年上半年度，由富国基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汉兴证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务报表(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：汉兴证券投资基金

报告截止日：2014 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2014 年 06 月 30 日)	上年度末 (2013 年 12 月 31 日)
<b>资产：</b>		
银行存款	768,862.40	45,787,358.45
结算备付金	60,776,169.31	42,231,243.52
存出保证金	1,756,562.16	557,073.12
交易性金融资产	2,763,089,145.43	2,995,037,981.71
其中：股票投资	2,173,098,781.43	2,355,039,386.01
基金投资	—	—
债券投资	589,990,364.00	639,998,595.70
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	105,000,252.50	—

应收证券清算款	25,744,614.74	—
应收利息	13,521,086.62	9,279,420.59
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	2,970,656,693.16	3,092,893,077.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>(2014年06月30日)</b>	<b>(2013年12月31日)</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	12,816,080.57	32,957,843.85
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	3,545,231.63	3,902,880.46
应付托管费	590,871.96	650,480.06
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	4,266,488.18	1,385,938.64
应交税费	1,729,986.50	1,729,986.50
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	642,518.49	564,000.00
负债合计	23,591,177.33	41,191,129.51
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	-52,934,484.17	51,701,947.88
所有者权益合计	2,947,065,515.83	3,051,701,947.88
负债和所有者权益总计	2,970,656,693.16	3,092,893,077.39

注：报告截止日 2014 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9824 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汉兴证券投资基金

本报告期：2014 年 01 月 01 日至 2014 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2014年01月01日至 2014年06月30日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至 2013年06月30日)
一、收入	-59,780,858.70	-30,488,388.02

1. 利息收入	15,339,938.93	10,973,790.21
其中：存款利息收入	2,077,806.88	444,644.79
债券利息收入	12,948,889.80	10,529,145.42
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	313,242.25	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-46,188,247.41	207,897,482.75
其中：股票投资收益	-55,983,566.54	186,327,311.75
基金投资收益	—	—
债券投资收益	1,490,309.12	945,120.00
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	8,305,010.01	20,625,051.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-28,932,550.22	-249,359,660.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	—	—
<b>减：二、费用</b>	44,855,573.35	32,584,037.47
1. 管理人报酬	22,126,081.43	21,952,693.87
2. 托管费	3,687,680.28	3,658,782.34
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	18,714,471.97	6,782,998.77
5. 利息支出	135,244.18	—
其中：卖出回购金融资产支出	135,244.18	—
6. 其他费用	192,095.49	189,562.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-104,636,432.05	-63,072,425.49
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-104,636,432.05	-63,072,425.49

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汉兴证券投资基金

本报告期：2014年01月01日至2014年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2014年01月01日至2014年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	51,701,947.88	3,051,701,947.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-104,636,432.05	-104,636,432.05
三、本期基金份额交易产生的基金	—	—	—

净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	-52,934,484.17	2,947,065,515.83
项目	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	-188,738,583.77	2,811,261,416.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-63,072,425.49	-63,072,425.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	-251,811,009.26	2,748,188,990.74

注：所附附注为本会计报表的组成部分

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈	林志松	雷青松
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汉兴证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[1999]38号文《关于同意设立汉兴证券投资基金的批复》的核准，由海通证券股份有限公司（原名为海通证券有限公司）、华泰证券股份有限公司（原名为江苏证券有限责任公司）及富国基金管理有限公司于1999年12月24日共同发起并向社会募集设立。本基金为契约型封闭式，存续期为15年，发行规模为30亿份基金份额。本基金经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证上字[2000]1号文审核同意，于2000年1月10日在上交所挂牌交易。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，基金托管人为

交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金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。本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，其中投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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》、《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》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

#### **6.4.5 会计差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

##### **1. 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### **2. 营业税、企业所得税**

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式

向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 3. 个人所得税

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》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，对于证券投资基金通过公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）
活期存款	768,862.40
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	768,862.40

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,114,334,519.16	2,173,098,781.43	58,764,262.27
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—



债券	交易所市场	57,004,905.70	56,958,364.00	-46,541.70
	银行间市场	537,299,043.33	533,032,000.00	-4,267,043.33
	合计	594,303,949.03	589,990,364.00	-4,313,585.03
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		2,708,638,468.19	2,763,089,145.43	54,450,677.24

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

金额单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间	105,000,252.50	0.00
合计	105,000,252.50	0.00

注：本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）
应收活期存款利息	551.47
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	102,589.10
应收债券利息	13,403,161.16
应收买入返售证券利息	14,073.53
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	711.36
合计	13,521,086.62

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本报告期末本基金未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）
交易所市场应付交易费用	4,265,404.93
银行间市场应付交易费用	1,083.25
合计	4,266,488.18

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	—
预提上市年费	29,752.78
预提审计费	149,588.57
预提信息披露费	99,177.14
其他应付款其他	114,000.00
合计	642,518.49

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00

注：本基金的发起人海通证券股份有限公司持有 500 万份、占比 0.17%，华泰证券股份有限公司持有 500 万份、占比 0.17%，富国基金管理有限公司持有 1,000 万份、占比 0.33%。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-31,681,279.58	83,383,227.46	51,701,947.88
本期利润	-75,703,881.83	-28,932,550.22	-104,636,432.05
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-107,385,161.41	54,450,677.24	-52,934,484.17

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
活期存款利息收入	225,108.21
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	1,842,756.90
其他	9,941.77

合计	2,077,806.88
----	--------------

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
卖出股票成交总额	6,243,301,005.48
减：卖出股票成本总额	6,299,284,572.02
买卖股票差价收入	-55,983,566.54

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成交总额	532,202,360.72
减：卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成本总额	517,644,555.67
减：应收利息总额	13,067,495.93
债券投资收益	1,490,309.12

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
股票投资产生的股利收益	8,305,010.01
基金投资产生的股利收益	—
合计	8,305,010.01

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
1. 交易性金融资产	-28,932,550.22
股票投资	-42,567,044.19
债券投资	13,634,493.97
资产支持证券投资	—
基金投资	—

贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
合计	-28,932,550.22

#### 6.4.7.19 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
交易所市场交易费用	18,708,921.97
银行间市场交易费用	5,550.00
合计	18,714,471.97

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
审计费用	49,588.57
信息披露费	99,177.14
银行汇划费用	4,577.00
上市费	29,752.78
债券账户维护费	9,000.00
合计	192,095.49

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东
申银万国证券股份有限公司（“申银万国”）	基金管理人的股东
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2014年01月01日至2014年06月30日)		上年度可比期间(2013年01月01日至2013年06月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	1,435,715,638.71	11.63	511,672,384.56	11.45
申银万国	3,191,364,649.23	25.85	477,913,018.64	10.69

##### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方发生权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方发生回购交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2014年01月01日至2014年06月30日)			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
申银万国	2,840,884.77	25.77	1,015,483.68	23.81
海通证券	1,270,466.57	11.53	766,648.22	17.97
关联方名称	上年度可比期间(2013年01月01日至2013年06月30日)			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
海通证券	452,779.05	11.28	224,122.14	12.97
申银万国	434,296.92	10.82	57,455.49	3.33

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期(2014年01月01日至2014年06月30日)	上年度可比期间(2013年01月01日至2013年06月30日)

当期发生的基金应支付的管理费	22,126,081.43	21,952,693.87
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：基金管理人的管理费每日计算，按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提，基金成立三个月后，如持有现金比例高于基金资产净值的 20%，超出部分不计提管理费。计算方法为：

$$H = E * 1.50\% / \text{当年天数}$$

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（扣除基金持有现金比例超过 20% 部分的资产净值）

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2014年01月01日至 2014年06月30日)	上年度可比期间(2013年01月 01日至2013年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	3,687,680.28	3,658,782.34

注：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，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生关联方银行间债券(含回购)的交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期(2014年01月01日至2014 年06月30日)	上年度可比期间(2013年01 月01日至2013年06月30日)
基金合同生效日(1999年 12月30日)持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基 金总份额比例	0.33%	0.33%

注：本基金管理人作为本基金发起人之一在本基金发行期间认购 1000 万份额，其认购费率是公允的。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末（2014年06月30日）		上期末（2013年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
海通证券	5,000,000.00	0.17	5,000,000.00	0.17

注：表中关联方持有基金份额是其作为本基金发起人在本基金发行期间认购的，其认购费率是公允的。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）		上年度可比期间（2013年01月01日至2013年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	768,862.40	225,108.21	20,218,788.31	83,088.12

注：本基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户的证券交易结算资金余额2014年上半年末为60,776,169.31元，2013年上半年末为51,053,156.35元。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2014年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603328	依顿电子	2014-06-23	2014-07-01	新股认购	15.31	15.31	70,600	1,080,886.00	1,080,886.00	—

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300318	博晖创新	2014-06-25	筹划重大事项	21.39	—	—	2,262,939	47,034,660.87	48,404,265.21	注1

注：1)因股票未恢复交易，复牌日期及复牌开盘单价未知。

### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

注：截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额；没有因正回购而作为抵押的银行间市场债券。

#### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无证券交易所债券正回购，未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

### **6.4.13 金融工具风险及管理**

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本



基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

#### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2014年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	768,862.40	—	—	—	—	—	768,862.40
结算备付金	60,776,169.31	—	—	—	—	—	60,776,169.31
存出保证金	1,756,562.16	—	—	—	—	—	1,756,562.16
交易性金融资产	47,465,000.00	98,725,000.00	142,930,000.00	207,981,500.00	92,888,864.00	2,173,098,781.43	2,763,089,145.43
买入返售金融资产	105,000,252.50	—	—	—	—	—	105,000,252.50
应收证券清算款	—	—	—	—	—	25,744,614.74	25,744,614.74
应收利息	—	—	—	—	—	13,521,086.62	13,521,086.62
资产总计	215,766,846.37	98,725,000.00	142,930,000.00	207,981,500.00	92,888,864.00	2,212,364,482.79	2,970,656,693.16
负债							
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—	—	—
应付证券清算款	—	—	—	—	—	12,816,080.57	12,816,080.57
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	3,545,231.63	3,545,231.63
应付托管费	—	—	—	—	—	590,871.96	590,871.96
应付交易费用	—	—	—	—	—	4,266,488.18	4,266,488.18
应付税费	—	—	—	—	—	1,729,986.50	1,729,986.50
其他负债	—	—	—	—	—	642,518.49	642,518.49
负债总计	—	—	—	—	—	23,591,177.33	23,591,177.33
利率敏感度缺口	215,766,846.37	98,725,000.00	142,930,000.00	207,981,500.00	92,888,864.00	2,188,773,305.46	2,947,065,515.83
上年度末（2013年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	45,787,358.45	—	—	—	—	—	45,787,358.45
结算备付金	42,231,243.52	—	—	—	—	—	42,231,243.52
存出保证金	557,073.12	—	—	—	—	—	557,073.12
交易性金融资产	96,918,250.20	47,560,000.00	242,754,145.00	164,127,000.00	88,639,200.50	2,355,039,386.01	2,995,037,981.71
应收利息	—	—	—	—	—	9,279,420.59	9,279,420.59
资产总计	185,493,925.29	47,560,000.00	242,754,145.00	164,127,000.00	88,639,200.50	2,364,318,806.60	3,092,893,077.39
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	32,957,843.85	32,957,843.85
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	3,902,880.46	3,902,880.46
应付托管费	—	—	—	—	—	650,480.06	650,480.06
应付交易费用	—	—	—	—	—	1,385,938.64	1,385,938.64
应付税费	—	—	—	—	—	1,729,986.50	1,729,986.50
其他负债	—	—	—	—	—	564,000.00	564,000.00
负债总计	—	—	—	—	—	41,191,129.51	41,191,129.51
利率敏感度缺口	185,493,925.29	47,560,000.00	242,754,145.00	164,127,000.00	88,639,200.50	2,323,127,677.09	3,051,701,947.88

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2014年06月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-994,471.35	-1,035,576.82
	2. 基准点利率减少0.1%	994,471.35	1,035,576.82

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资组合中投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值80%；投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）		上年度末（2013年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,173,098,781.43	73.74	2,355,039,386.01	77.17
交易性金融资产—债券投资	589,990,364.00	20.02	639,998,595.70	20.97
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,763,089,145.43	93.76	2,995,037,981.71	98.14

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

本基金合同没有规定业绩比较基准，本基金根据基金长期运作的资产组合比例，拟定将 80%的沪深 300 指数加上 20%中国债券总指数作为基准进行敏感性分析。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2014年06月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	1.80%* 沪深 300 指数 +20%*中国债券总指数增加 1%	33,399,187.42	27,917,693.48
	2.80%* 沪深 300 指数 +20%*中国债券总指数减少 1%	-33,399,187.42	-27,917,693.48

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,173,098,781.43	73.15
	其中：股票	2,173,098,781.43	73.15
2	固定收益投资	589,990,364.00	19.86
	其中：债券	589,990,364.00	19.86
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	105,000,252.50	3.53

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	61,545,031.71	2.07
7	其他各项资产	41,022,263.52	1.38
8	合计	2,970,656,693.16	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,398,000.00	0.05
B	采矿业	37,518,663.02	1.27
C	制造业	1,474,807,940.87	50.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	293,410,048.60	9.96
F	批发和零售业	126,128,755.05	4.28
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	34,169,082.51	1.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,382,472.38	4.87
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	62,283,819.00	2.11
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,173,098,781.43	73.74

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600703	三安光电	7,376,011	172,819,937.73	5.86
2	300049	福瑞股份	5,515,145	158,836,176.00	5.39
3	300005	探路者	9,904,899	152,931,640.56	5.19
4	002568	百润股份	7,263,786	130,748,148.00	4.44
5	600667	太极实业	27,008,725	125,050,396.75	4.24
6	002375	亚厦股份	5,500,000	124,080,000.00	4.21
7	002431	棕榈园林	6,335,302	112,768,375.60	3.83
8	600060	海信电器	10,899,905	105,184,083.25	3.57
9	600150	中国船舶	4,848,870	102,117,202.20	3.47

10	300300	汉鼎股份	3,555,246	94,533,991.14	3.21
11	600858	银座股份	10,502,205	73,620,457.05	2.50
12	300016	北陆药业	5,307,273	66,022,476.12	2.24
13	300008	上海佳豪	3,729,570	62,283,819.00	2.11
14	300007	汉威电子	2,849,401	61,148,145.46	2.07
15	300326	凯利泰	1,606,553	60,213,606.44	2.04
16	600312	平高电气	4,277,521	59,628,642.74	2.02
17	300246	宝莱特	2,299,788	59,518,513.44	2.02
18	600248	延长化建	7,705,950	56,561,673.00	1.92
19	300207	欣旺达	1,904,240	55,603,808.00	1.89
20	601933	永辉超市	8,308,275	52,508,298.00	1.78
21	300318	博晖创新	2,262,939	48,404,265.21	1.64
22	300226	上海钢联	1,276,917	47,552,389.08	1.61
23	300206	理邦仪器	2,216,220	47,050,350.60	1.60
24	300157	恒泰艾普	2,899,433	37,518,663.02	1.27
25	600754	锦江股份	2,082,211	34,169,082.51	1.16
26	002550	千红制药	1,605,243	31,061,452.05	1.05
27	300289	利德曼	600,000	15,630,000.00	0.53
28	600887	伊利股份	180,390	5,974,516.80	0.20
29	000596	古井贡酒	259,878	4,955,873.46	0.17
30	600559	老白干酒	94,416	1,979,903.52	0.07
31	000858	五粮液	100,000	1,793,000.00	0.06
32	600137	浪莎股份	135,170	1,743,693.00	0.06
33	600298	安琪酵母	100,000	1,458,000.00	0.05
34	002069	獐子岛	100,000	1,398,000.00	0.05
35	000568	泸州老窖	80,000	1,310,400.00	0.04
36	300150	世纪瑞尔	81,824	1,296,092.16	0.04
37	603328	依顿电子	70,600	1,080,886.00	0.04
38	002304	洋河股份	20,000	1,015,000.00	0.03
39	002726	龙大肉食	50,124	855,115.44	0.03
40	000876	新希望	50,000	564,500.00	0.02
41	603006	黎明股份	7,567	108,208.10	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002482	广田股份	314,892,135.59	10.32
2	600703	三安光电	266,564,736.68	8.73
3	002375	亚厦股份	226,374,663.65	7.42
4	300049	福瑞股份	221,357,151.78	7.25

5	600667	太极实业	219,197,013.32	7.18
6	600584	长电科技	191,746,570.55	6.28
7	600060	海信电器	172,437,633.84	5.65
8	002431	棕榈园林	171,936,265.54	5.63
9	300090	盛运股份	167,186,033.25	5.48
10	600418	江淮汽车	149,914,031.31	4.91
11	002550	千红制药	148,800,133.04	4.88
12	300005	探路者	137,053,748.91	4.49
13	002568	百润股份	132,805,259.98	4.35
14	600335	国机汽车	125,882,545.22	4.12
15	002325	洪涛股份	119,088,401.23	3.90
16	002081	金螳螂	101,233,149.85	3.32
17	002626	金达威	98,182,452.98	3.22
18	002185	华天科技	92,989,228.12	3.05
19	600150	中国船舶	92,986,119.18	3.05
20	002382	蓝帆股份	89,907,014.33	2.95
21	300300	汉鼎股份	84,323,480.48	2.76
22	600089	特变电工	82,970,450.89	2.72
23	300207	欣旺达	81,012,458.83	2.65
24	600787	中储股份	77,991,309.16	2.56
25	300246	宝莱特	73,804,476.01	2.42
26	002371	七星电子	73,761,823.10	2.42
27	600855	航天长峰	72,262,821.62	2.37
28	600292	中电远达	68,640,914.57	2.25
29	600261	阳光照明	68,350,357.76	2.24
30	002156	通富微电	66,526,852.38	2.18

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002482	广田股份	246,272,192.12	8.07
2	600584	长电科技	198,383,496.75	6.50
3	600703	三安光电	191,917,158.30	6.29
4	600418	江淮汽车	156,650,359.31	5.13
5	002550	千红制药	142,212,034.11	4.66
6	002626	金达威	141,460,017.52	4.64
7	600335	国机汽车	133,878,026.83	4.39
8	300090	盛运股份	122,493,593.78	4.01
9	002325	洪涛股份	109,706,081.00	3.59
10	300367	东方网力	100,990,215.76	3.31



11	600667	太极实业	98,196,939.31	3.22
12	600570	恒生电子	98,009,168.82	3.21
13	600060	海信电器	95,962,967.89	3.14
14	002081	金螳螂	87,418,199.69	2.86
15	002185	华天科技	86,403,775.89	2.83
16	300257	开山股份	84,540,198.16	2.77
17	600887	伊利股份	84,437,019.30	2.77
18	601318	中国平安	83,009,064.56	2.72
19	601166	兴业银行	82,821,230.13	2.71
20	600089	特变电工	81,727,225.68	2.68
21	600171	上海贝岭	81,309,482.45	2.66
22	002375	亚厦股份	75,867,852.81	2.49
23	600855	航天长峰	75,764,727.25	2.48
24	002382	蓝帆股份	75,714,198.39	2.48
25	000887	中鼎股份	73,897,913.71	2.42
26	600787	中储股份	68,794,673.25	2.25
27	000001	平安银行	68,099,215.49	2.23
28	600030	中信证券	67,869,335.13	2.22
29	600292	中电远达	66,295,732.83	2.17
30	600261	阳光照明	64,894,846.74	2.13
31	600080	金花股份	61,913,174.26	2.03
32	002431	棕榈园林	61,353,882.26	2.01

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,159,911,011.63
卖出股票收入（成交）总额	6,243,301,005.48

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	76,868,364.00	2.61
2	央行票据	—	—
3	金融债券	513,122,000.00	17.41
	其中：政策性金融债	513,122,000.00	17.41
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	589,990,364.00	20.02

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	130228	13 国开 28	700,000	69,251,000.00	2.35
2	130327	13 进出 27	500,000	50,035,000.00	1.70
3	090417	09 农发 17	500,000	49,860,000.00	1.69
4	120316	12 进出 16	500,000	49,620,000.00	1.68
5	110233	11 国开 33	500,000	48,700,000.00	1.65

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,756,562.16
2	应收证券清算款	25,744,614.74
3	应收股利	—
4	应收利息	13,521,086.62
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	41,022,263.52

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份	持有份额	占总份

			额比例 (%)		额比例 (%)
39124	76,679.28	2,315,874,088.00	77.20	684,125,912.00	22.80

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中国人寿保险(集团)公司	505,777,807	16.86
2	中国人寿保险股份有限公司	267,179,609	8.91
3	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L—FH002 沪	216,600,133	7.22
4	中国太平洋财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品—013C—CT001 沪	186,689,515	6.22
5	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品	108,708,784	3.62
6	太平人寿保险有限公司	91,603,541	3.05
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	83,447,144	2.78
8	中国太平洋保险(集团)股份有限公司—集团本级—自有资金—012G—ZY001 沪	70,232,692	2.34
9	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—银保分红	52,599,936	1.75
10	中国人寿再保险股份有限公司	48,908,672	1.63

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(1999年12月30日)基金份额总额	3,000,000,000.00
报告期期初基金份额总额	3,000,000,000.00
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	3,000,000,000.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

---

本基金管理人已于 2014 年 1 月 29 日和 2014 年 1 月 30 日发布公告，陈戈先生自 2014 年 1 月 29 日起由公司副总经理转任公司总经理。

本基金管理人已于 2014 年 5 月 13 日发布公告，孟朝霞女士自 2014 年 5 月 12 日起不再担任公司副总经理。

本基金管理人已于 2014 年 6 月 20 日发布公告，陆文佳女士自 2014 年 6 月 19 日起任公司副总经理。

### **10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼事项。

### **10.4 基金投资策略的改变**

本报告期本基金投资策略无改变。

### **10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

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。

### **10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

2014 年 6 月 23 日，中国证券监督管理委员会上海监管局向我司下发了《关于对富国基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求我司于 2014 年 7 月 8 日前予以改正，并对相关责任人采取了行政监管措施。对此我司高度重视，成立了整改工作小组，梳理相关制度流程，排查现行内控漏洞，针对性的制定了整改执行方案，完善了公司内部控制措施，并已向中国证券监督管理委员会上海监管局提交了整改报告。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	1,435,715,638.71	11.63	—	—	—	—	—	—	1,270,466.57	11.53	—
中信证券	1	842,728,361.15	6.83	—	—	364,300,000.00	47.66	—	—	767,210.63	6.96	—
银河证券	2	2,134,747,958.71	17.29	—	—	—	—	—	—	1,900,348.70	17.24	—
齐鲁证券	1	1,167,742,611.53	9.46	—	—	—	—	—	—	1,030,837.21	9.35	—
方正证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中金公司	1	700,019,392.02	5.67	20,512,972.90	100.00	—	—	—	—	637,297.29	5.78	—
中投证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华泰证券	1	1,283,222,010.46	10.39	—	—	400,000,000.00	52.34	—	—	1,168,238.06	10.60	—
平安证券	2	976,545,052.41	7.91	—	—	—	—	—	—	864,934.15	7.85	—
申银万国	2	3,191,364,649.23	25.85	—	—	—	—	—	—	2,840,884.77	25.77	—
长城证券	1	613,822,714.62	4.97	—	—	—	—	—	—	543,172.91	4.93	—
招商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：1. 我公司对基金交易单元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。

2. 本期内本基金租用的券商交易单元无变更。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于增聘汉兴证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报	2014年01月13日
2	富国基金管理有限公司关于汉兴证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报	2014年01月29日
3	富国基金管理有限公司关于高管人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年01月29日
4	富国基金管理有限公司关于高管人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年01月30日
5	富国基金管理有限公司关于高管人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014年05月13日
6	富国基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014年06月20日

## § 11 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
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	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17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： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a>

---

上披露的各项公告		
----------	--	--