

基金管理人:富国基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年01月22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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

本基金报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 富国汉兴封闭

基金代码 500015

交易代码 500015

基金运作方式 约期型封闭式

基金合同生效日 1999年05月10日

报告期末基金份额总额(单位:份) 2,000,000,000.00

投资目标 为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋取基金长盛续的投資收益。

投资策略 “精选品种，组合投资，波段操作”，通过研究和精选投资标的，实现投资前长期的上市公司进行组合投资，以长期投资为主，同时依据“顺势而为”的原则进行一些短期操作。

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 中国农业银行股份有限公司

§ 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(2013年10月01日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -11,390,015.56

2.本期利润 -27,023,757.79

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0135

4.期末基金资产净值 2,497,926,041.59

5.期末基金份额净值 1.2490

注:上述基金净值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将低于所列数字。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 本基金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 -1.07% 2.46% - - - -

注:过去三个月指2013年10月1日至2013年12月31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:截至2013年12月31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,此图示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比例均符合基金合同的约定。

§ 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间 证券从业年限 说明

贾轶 本基金基金经理兼固定收益投资总监,富国汉兴基金经理 2010-01-13 - 13年

黄宣 本基金基金经理兼固定收益投资总监,富国汉兴基金经理 2012-10-12 - 7年

戴蕴 本基金基金经理兼固定收益投资总监,富国汉兴基金经理 2012-10-12 - 7年

注:本基金基金经理于2014年01月13日公告戴蕴强先生由2014年01月13日起不再担任本基金基金经理,贺轶先生和黄宣先生继续担任本基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作情况报告及遵规守信情况说明

报告期内,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》以及其他有关法律法规的规定,基金合同约定的基金收益分配原则,以及基金合同和招募说明书中载明的基金收益分配政策,履行了基金收益分配义务,不存在损害基金份额持有人利益的行为,基金运作符合法律法规和基金合同的规定。

4.3 公司交易行为的专项说明

本基金管理人将根据相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理制度》,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、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合有合理的交易机会,均等地享受机会,并保持各组合的公平交易制度。

4.4 报告期内基金的经营业绩和运作分析

四季度以来,我国经济运行平稳,但股市受到流动性紧张、IPO重启等因素的影响,整体呈现区间震荡,略显下行的态势。同时,受到八届三中全会改革纲领的推动,土地流转、价格改革、国企改制等主题成为股市热点。本基金部分参与了上述热点主题的炒作,获取了一定的收益。

展望未来,本基金将密切关注宏观流动性和股市的供给压力,利用上述两个因素得到缓解的窗口期,

注:截止日期为2013年12月31日。

4.5 投资组合报告

4.5.1 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 1,587,339,546.39 63.22

其中:股票 1,587,339,546.39 63.22

2 固定收益投资 642,256,171.40 25.58

其中:债券 642,256,171.40 25.58

货币市场基金 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 其他资产 175,600.00 0.69

5 衍生工具 - -

6 其他资产 70,385,935.93 2.80

7 合计 35,267,635.64 1.40

100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农林、牧、渔业 - -

2 矿采、水利 - 0.08

3 制造业 1,064,941,125.87 42.63

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 9,701,785.59 0.39

5 建筑业 4,222,851.52 0.17

6 批发、零售业 245,981,414.79 9.85

7 交通运输、仓储和邮政业 13,193,293.10 0.53

8 信息传输、软件和信息技术服务业 156,889,100.80 6.28

9 金融业 90,351,720.87 3.62

10 房地产业 1,826,373.77 0.65

11 其他行业 1,887,339,546.39 63.55

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 证券代码 证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000703 三安光电 245,501,592.29 9.83

2 000423 东华能源 125,462,601.56 5.02

3 600060 海信电器 9,700,785.59 0.39

4 600649 金利华电 3,700,268.00 0.14

5 300089 丽珠集团 7,500,818.00 0.28

6 600649 诚志股份 7,879,640.00 2.63

7 601607 上海医药 63,687,771.40 2.56

8 600761 安泰科技 4,216,322.00 1.64

9 600529 中国重工 1,352,500.00 0.51

10 002903 京能电力 44,186,363.16 1.77

11 000960 申能股份 2,530.00 0.01

12 600060 海信电器 40,392,821.00 1.63

5.4 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债券投资组合情况

序号 证券代码 证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100001 国债 94,946,900.00 3.80

2 100002 企业债 1,355,039,386.01 76.14

3 100003 企业债 529,425,000.00 21.19

4 企业债 529,425,000.00 21.19

5 企业债 17,671,784.10 0.71

6 企业债 5,394,500.00 0.21

7 中期票据 209,487.30 0.01

8 其他 - -

9 合计 642,256,171.40 25.71

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 证券代码 证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000703 三安光电 245,501,592.29 9.83

2 000423 东华能源 125,462,601.56 5.02

3 600060 海信电器 9,700,785.59 0.39

4 600649 金利华电 3,700,268.00 0.14

5 300089 丽珠集团 7,500,818.00 0.28

6 600649 诚志股份 7,879,640.00 2.63

7 601607 上海医药 63,687,771.40 2.56

8 600761 安泰科技 4,216,322.00 1.64

9 600529 中国重工 1,352,500.00 0.51

10 002903 京能电力 44,186,363.16 1.77

11 000960 海信电器 2,530.00 0.01

12 600060 海信电器 40,392,821.00 1.63

5.6 报告期未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

序号 证券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 130262 13国开18 500,000 49,685,000.00 1.63

2 130327 13进04 200,000 70,000 2.77

3 130428 13农发28 500,000 49,293,000.00 1.99

4 130007 13附息国债07 500,000 49,720,000.00 1.99

5 130328 13农发14 500,000 49,620,000.00 1.99

5.7 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

序号 证券代码 证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000703 三安光电 3,123,524.39

2 235,652,225.76

3 8,