富国消费主题混合型证券投资基金(原汉兴证券投资基金转型)

【2014】年度报告摘要

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：	2015年03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根据本基金合同规定，于2015年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

自2014年12月12日汉兴证券投资基金终止上市日起，原汉兴证券投资基金转型为富国消费主题混合型证券投资基金。原汉兴证券投资基金报告期为2014年1月1日至2014年12月11日，富国消费主题混合型证券投资基金报告期为2014年12月12日至2014年12月31日。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

2.1.1转型前基金（原汉兴证券投资基金）基本情况

基金简称	富国基金汉兴
场内简称	基金汉兴
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

2.1.2转型后基金（富国消费主题混合型证券投资基金）基本情况

基金简称	富国消费主题
场内简称	富国消费
基金主代码	519915
交易代码	前端交易代码:519915 后端交易代码:-
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2014年12月12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	3,001,179,202.31份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

2.2.1转型前基金（原汉兴证券投资基金）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

2.2.2转型后基金（富国消费主题混合型证券投资基金）产品说明

投资目标	本基金主要投资于大消费行业中具有持续增长潜力的优质上市公司，以分享中国经济增长与结构转型带来的投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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	汤嵩彦
	联系电话	021-20361818	95559
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		95105686,4008880688	95559
传真		021-20361616	021-62701216

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fullgoal.com.cn/
基金年度报告备置地点	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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	转型前（2014年1月1日至2014年12月11日）	2014年12月12日(基金合同生效日)至2014年12月31日	2013年	2012年
本期已实现收益	-5,864,806.92	-78,339,756.64	263,038,784.97	-309,993,408.73
本期利润	137,093,840.25	-144,124,283.17	240,440,531.65	124,907,770.96
加权平均基金份额本期利润	0.0457	-0.0480	0.0801	0.0416
本期基金份额净值增长率	4.49%	-6.54%	8.55%	4.65%
3.1.2期末数据和指标	转型前（2014年12月11日）	2014年12月31日	2013年12月31日	2012年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.0125	-0.0386	-0.0106	-0.0982
期末基金资产净值	3,188,795,788.13	3,045,948,581.02	3,051,701,947.88	2,811,261,416.23
期末基金份额净值	1.0629	1.015	1.0172	0.9371

注：本基金于2014年12月12日转型，新基金合同生效日为2014年12月12日，截至报告期末新基金合同生效不足一年。

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、开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。

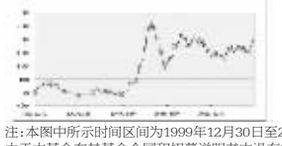
3.2转型前基金汉兴证券投资基金净值表现

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
过去三个月	-2.08%	3.26%	-	-	-	-
过去六个月	8.19%	2.43%	-	-	-	-
过去一年	4.49%	2.34%	-	-	-	-
过去三年	18.69%	2.20%	-	-	-	-
过去五年	-11.52%	2.09%	-	-	-	-
自基金合同生效日起至今	181.57%	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

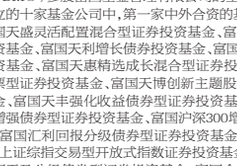


注：本图中所示时间区间为1999年12月30日至2014年12月11日。

由于本基金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。

3.2.3自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2014年按实际存续期计算。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。

3.3转型后基金富国消费主题混合型证券投资基金净值表现

3.3.1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
自基金合同生效日起至今	-6.54%	1.68%	8.66%	1.50%	-15.20%	0.18%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映A股市场总体价格走势。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（benchmark）按下列公式计算：

benchmarkt =80%* [沪深300指数t/(沪深300指数t-1)-1] +20%* [中债综合指数t/(中债综合指数t-1)-1]；

其中，t=1,2,3,***，T,T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmarkt)]-1

其中，T=2,3,4,***；∏Tt=1(1+benchmarkt)表示t日至T日的(1+benchmarkt)数学连乘。

3.3.2自基金转型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：1、本图中所示时间区间为2014年12月12日至2014年12月31日，本基金自基金转型日至图表截止日不足一年。

2、富国消费主题混合型证券投资基金由汉兴证券投资基金转型而成。基金转型经2014年10月16日至2014年11月10日汉兴证券投资基金基金份额持有人大会决议通过。自2014年12月12日起，由《汉兴证券投资基金基金合同》修订而成的《富国消费主题混合型证券投资基金基金合同》生效，原《汉兴证券投资基金基金合同基金合同》自同一日起失效。

3、本基金于2014年12月12日由原汉兴证券投资基金转型而成，建仓期6个月，

截止至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

3.3.3自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：2014年按实际存续期计算。

3.4过去三年基金的利润分配情况

注：过往三年本基金未进行利润分配。

§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12月31日，本基金管理人共管理富国天惠灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、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、富国天盈分级债券型证券投资基金、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、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国收益宝货币市场基金等五十三只证券投资基金。

4.1.2基金经理（或基金经理小组）简介

原汉兴证券投资基金：

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行业股票型证券投资基金基金经理	2014-01-13	-	8年	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	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。

富国消费主题混合型证券投资基金：

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 兼任富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理	2014-12-12	-	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（2014年12月汉兴证券投资基金转型为富国消费主题混合型证券投资基金后继续担任富国消费主题混合型证券投资基金基金经理）。具有基金从业资格。

注：戴益强先生自2014年1月13日起担任汉兴证券投资基金基金经理；2014年12月12日汉兴证券投资基金转型为富国消费主题混合型证券投资基金，戴益强先生继续担任富国消费主题混合型证券投资基金基金经理。

4.2管理人对投告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国消费主题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》、《富国消费主题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，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，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公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行1分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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。

4.3.3异常交易行为的专项说明

（1）自2014年1月1日至2014年9月30日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，报告期内汉兴证券投资基金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8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。

（2）自2014年10月1日至2014年12月11日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，报告期内汉兴证券投资基金与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

（3）自2014年12月12日至2014年12月31日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，报告期内富国消费主题混合型证券投资基金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3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年整体经济运行速度缓慢下行，货币政策年底开始放松，全年我们控制在中等仓位水平，通过寻找结构性机会来为持有人获取持续收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月11日，汉兴证券投资基金份额净值为1.0629元，份额累计净值为2.6015元；自2014年1月1日至2014年12月11日，汉兴证券投资基金净值增长率为4.49%（汉兴证券投资基金在其基金合同中未设置业绩比较基准）；截至2014年12月31日，富国消费主题混合型证券投资基金份额净值为1.015元，份额累计净值为1.015元，2014年12月12日至2014年12月31日基金份额净值增长率为-6.54%，同期业绩比较基准收益率为8.66%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们长期还是看好中国依靠创新力量获得下一轮经济上行的根本动力，因此更多的还是在细分龙头和中小市值股票中寻找机会，希望可以给投资者贡献更多的收益。

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

根据相关法律法规、《汉兴证券投资基金基金合同》、《富国消费主题混合型证券投资基金基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，2014年报告期内汉兴证券投资基金以及富国消费主题混合型证券投资基金均未进行收益分配。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。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期无需要说明的相关情形。

§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年度，基金托管人在富国消费主题混合型证券投资基金（原汉兴证券投资基金）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年度，富国基金管理有限公司在富国消费主题混合型证券投资基金（原汉兴证券投资基金）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富国消费主题混合型证券投资基金（原汉兴证券投资基金）的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 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§7 转型前基金（汉兴证券投资基金）年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体：汉兴证券投资基金

报告截止日：2014年12月11日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年12月11日	上年度末 （2013年12月31日）
资 产：		
银行存款	73,634,868.08	45,787,358.45
结算备付金	65,097,432.92	42,231,243.52
存出保证金	3,297,780.70	557,073.12
交易性金融资产	2,816,848,845.39	2,995,037,981.71
其中：股票投资	2,167,780,507.79	2,355,039,386.01
基金投资	-	-
债券投资	649,068,337.60	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	-	-
应收证券清算款	231,957,579.47	-
应收利息	13,558,670.29	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	3,204,396,176.85	3,092,893,077.39
负债和所有者权益	本期末 2014年12月11日	上年度末 （2013年12月31日）
负 债：		
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	-	32,957,843.85
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,525,849.92	3,902,880.46
应付托管费	254,308.31	650,480.06
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	11,441,685.04	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	647,558.95	564,000.00
负债合计	15,599,388.72	41,191,129.51
所有者权益：		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	188,796,788.13	51,701,947.88
所有者权益合计	3,188,796,788.13	3,051,701,947.88
负债和所有者权益总计	3,204,396,176.85	3,092,893,077.39

注：1.报告截止日2014年12月11日（基金合同失效日），基金份额净值1.0629元，基金份额总额3,000,000,000.00份。

2.自2014年12月12日起，由《汉兴证券投资基金基金合同》修订而成的《富国消费主题混合型证券投资基金基金合同》生效。

7.2利润表

会计主体：汉兴证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月11日

单位：人民币元

项 目	本期 （2014年1月1日至2014年12月11日）	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年12月31日)
一、收入	243,430,832.99	304,645,511.50
1.利息收入	28,778,881.82	22,788,911.15
其中：存款利息收入	4,068,990.70	967,650.18
债券利息收入	24,348,877.17	21,773,036.45
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	361,013.95	48,224.52
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	71,693,304.00	304,316,243.90
其中：股票投资收益	56,142,451.44	266,295,918.38
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,066,493.28	690,757.91
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	13,484,359.28	37,329,567.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	142,958,647.17	-22,598,253.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	138,609.77
减：二、费用	106,336,992.74	64,204,979.85
1. 管理人报酬	43,254,588.52	44,492,681.40
2. 托管费	7,209,098.10	7,415,446.91
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	54,299,038.46	11,912,791.54
5. 利息支出	1,198,530.12	-
其中：卖出回购金融资产支出	1,198,530.12	-
6. 其他费用	375,737.54	384,060.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	137,093,840.25	240,440,531.65
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	137,093,840.25	240,440,531.65

7.3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1月1日至2014年12月11日

单位：人民币元

项目	本期 （2014年1月1日至2014年12月11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）	-	137,093,840.25	137,093,840.25
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	188,795,788.13	3,188,795,788.13
项目	上年度可比期间 （2013年01月01日至2013年12月31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）	-	240,440,531.65	240,440,531.65
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	51,701,947.88	3,051,701,947.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4报表附注

7.4.1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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.2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。

7.4.3关联方关系

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、基金发起人
申银万国证券股份有限公司（现名：申万宏源证券有限公司）	基金管理人的股东
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	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

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。

7.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 （2014年1月1日至2014年12月11日）		上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31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	3,905,491,886.78	10.92	889,260,239.64	11.32
申银万国	7,177,002,290.25	20.06	673,037,399.38	8.57

7.4.4.1.2权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.4.1.4回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 （2014年1月1日至2014年12月11日）		上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
申银万国	62,000,000.00	4.67	-	-

7.4.4.1.5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1月1日至2014年12月11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	3,455,973.98	10.80	1,185,093.39	10.36
申银万国	6,401,797.10	20.00	1,148,595.09	10.04
关联方名称	上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31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	786,907.34	11.19	88,215.94	6.37
申银万国	610,916.48	8.68	107,667.42	7.78

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。

7.4.4.2关联方报酬

7.4.4.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 （2014年1月1日至2014年12月11日）	上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	43,254,588.52	44,492,681.40
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%/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。

7.4.4.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 （2014年1月1日至2014年12月11日）	上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	7,209,098.10	7,415,446.91

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×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.3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均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.4.4各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1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1月1日至2014年12月11日）	上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31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	-	-
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。

7.4.4.4.2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12月11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