

富国天盛灵活配置混合型证券投资基金
(原汉盛证券投资基金转型)
二〇一四年半年度报告
(摘要)

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：中国农业银行股份有限公司

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

自 2014 年 4 月 30 日汉盛证券投资基金终止上市日起，原汉盛证券投资基金转型为富国天盛灵活配置混合型证券投资基金。原汉盛证券投资基金报告期为 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金报告期为 2014 年 4 月 30 日至 2014 年 6 月 30 日。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 转型前基金（原汉盛证券投资基金）基本情况

基金简称	富国汉盛封闭
场内简称	基金汉盛
基金主代码	500005
交易代码	500005
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年05月10日
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
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00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	1999年5月18日

2.1.2 转型后基金（富国天盛灵活配置混合型证券投资基金）基本情况

基金简称	富国天盛灵活配置混合
场内简称	—
基金主代码	000634
交易代码	前端交易代码：000634 后端交易代码：000635
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年04月30日
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
报告期末基金份额总额	1,653,976,030.52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（原汉盛证券投资基金）产品说明

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求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	“精选品种、组合投资、长线持有、波段操作”，通过研究和发掘具有良好发展前景的上市公司进行组合投资。以长期投资为主轴，同时依据“顺势而为”的原则进行一些短线操作。
业绩比较基准	无。
风险收益特征	无。

2.2.2 转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金产品说明

投资目标	本基金力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的个券选
------	---------------------------

	择，实现基金资产较高的长期回报。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析和定量分析贯穿与资产配置，行业细分，公司价值评估以及组合风险管理券过程中。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%.
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	李芳菲
	联系电话	021-20361818	010—66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816

2.4 信息披露方式

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 楼 中国农业银行 北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦

§ 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	转型前(2014年1月1日至2014年4月29日)	转型后(2014年4月30日(基金转型日)至2014年6月30日)
本期已实现收益	-28,946,619.18	12,916,339.07
本期利润	-69,784,396.96	95,511,820.48
加权平均基金份额本期利润	-0.0349	0.0525
本期基金份额净值增长率	-3.35%	6.77%
3.1.2 期末数据和指标	转型前(2014年4月29日)	转型后(2014年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0081	0.0187

期末基金资产净值	2,016,141,643.57	1,740,375,823.65
期末基金份额净值	1.0081	1.052

注：本基金于2014年4月30日转型，新基金合同生效日为2014年4月30日，截至报告期末新基金合同生效不满半年。

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 转型前基金汉盛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	-1.52%	1.73%	—	—	—	—
过去六个月	-3.35%	2.07%	—	—	—	—
过去一年	2.09%	1.99%	—	—	—	—
过去三年	8.16%	2.02%	—	—	—	—
自基金合同生效日起至今	551.46%	2.55%	—	—	—	—

注：由于基金汉盛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。

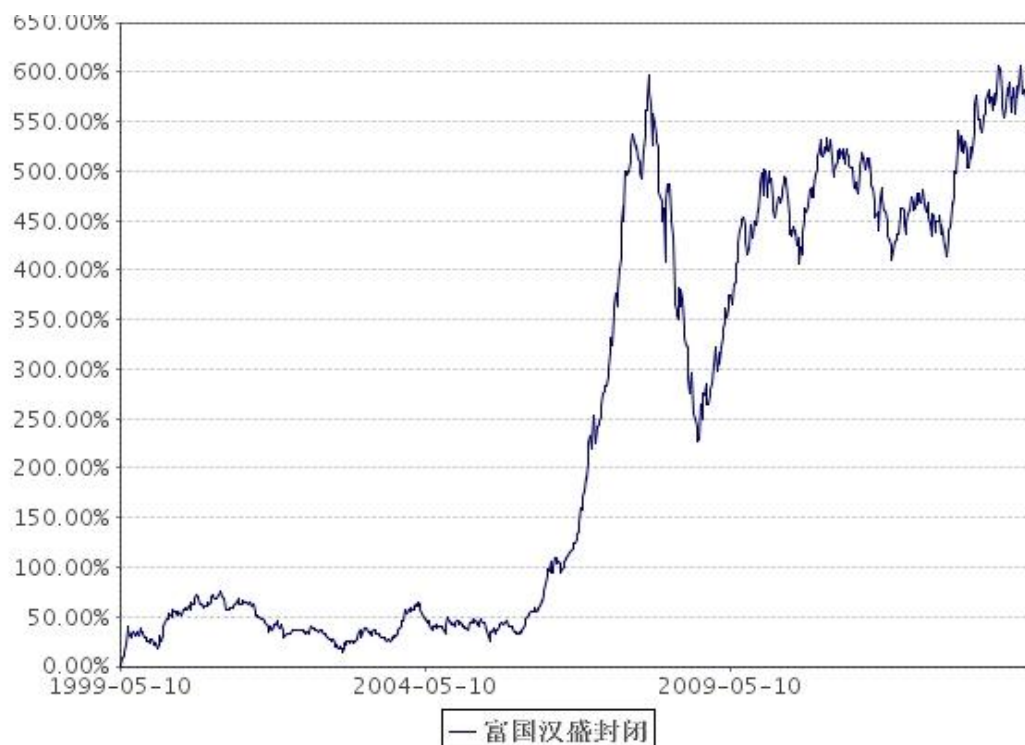
过去三个月为2014年4月1日至2014年4月29日。

过去六个月为2014年1月1日至2014年4月29日。

过去一年为2013年7月1日至2014年4月29日。

过去三年为2011年7月1日至2014年4月29日。

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：1. 本图中所示时间区间为 1999 年 5 月 10 日至 2014 年 4 月 29 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。
 2. 本基金于 1999 年 5 月 10 日成立，建仓期 6 个月，从 1999 年 5 月 10 日至 1999 年 11 月 9 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.3 转型后基金富国天盛灵活配置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
过去一个月	4.27%	1.09%	0.53%	0.51%	3.74%	0.58%
自基金合同生效日起至今	6.77%	0.93%	1.05%	0.51%	5.72%	0.42%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金业绩比较基准为：
 沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

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（benchmarkt）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkt} = 65\% * [\text{沪深 300 指数 t} / (\text{沪深 300 指数 t-1}) - 1] + 35\% * [\text{中债综合指数 t} / (\text{中债综合指数 t-1}) - 1];$$

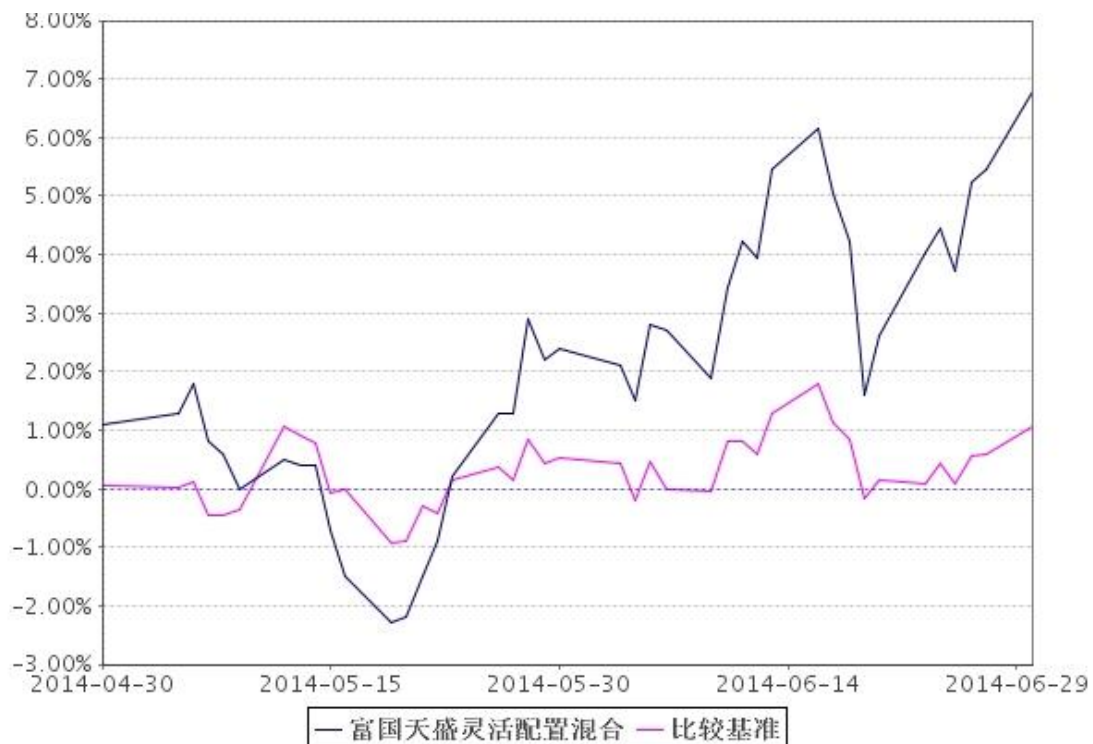
其中，t=1, 2, 3, ..., T, T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkT} = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})$ 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 4 月 30 日至 2014 年 6 月 30 日，本基金自基金转型日至图表截止日不足半年。

2、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金由汉盛证券投资基金转型而成。基金转型经 2014 年 3 月 6 日至 2014 年 4 月 8 日汉盛证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案（证券基金机构监管部部函[2014]67 号）。自 2014 年 4 月 30 日起，汉盛证券投资基金在上海证券交易所终止上市，其由《汉盛证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。

3、富国基金管理有限公司以 2014 年 6 月 4 日为份额折算基准日对投资者持有的原汉盛证券投资基金进行了基金份额折算操作。经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算前基金份额净值为 1.015 元，精确到小数点后第 9 位为 1.014909401 元（第 10 位舍去），本基金管理人按照 1.014909401 的折算比例对原汉盛证券投资基金进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值为 1.000 元，

折算后的基金份额为折算前的基金份额乘以折算比例，采用循环进位法保留到小数点后两位，折算后基金份额总额为 1,834,804,944.82 份。

4、本基金于 2014 年 4 月 30 日由原汉盛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。

§ 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

原汉盛证券投资基金：

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		

袁宜	本基金基金经理兼任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2012-10-12	—	8年	博士，曾任申银万国证券研究所有限公司宏观分析师、高级宏观分析师、高级策略分析师、首席策略分析师；2011年3月至今任富国基金管理有限公司首席经济学家，2011年3月至2012年10月任基金经理助理，2012年10月至2014年4月29日任汉盛证券投资基金基金经理，2013年4月起任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年4月30日起任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
戴益强	本基金前任基金经理	2012-10-12	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。
贺轶	本基金前任基金经理	2010-01-13	2014-01-29	13年	硕士，曾任中国银行云南省分行国际业务部银行职员；菲利普证券公司分析员；中银国际证券有限责任公司资产管理部分析员；中银基金管理有限公司投资部助理副总裁；汇丰晋信基金管理公司投资管理部投资经理、基金经理；富国基金管理有限公司营销策划与产品部高级营销策划经理、权益投资部策略分析师；2010年1月至2014年1月任汉盛证券投资基金基金经理，2012年9月起任富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金经理，兼任富国基金管理有限公司权益投资副总监。具有基金从业资格。

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，离任日期为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。

富国天盛灵活配置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		
袁宜	本基金基金经理兼任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014-04-30	—	8年	博士，曾任申银万国证券研究所有限公司宏观分析师、高级宏观分析师、高级策略分析师、首席策略分析师；2011年3月起任富国基金管理有限公司首席经济学家，2011年3月至2012年10月任基金经理助理，2012年10月至2014年4月29日任汉盛证券投资基金基金经理，2013年4月起任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年4月30日起任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注：上述表格内基金经理的任职日期为本基金转型后的基金合同生效日。

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。

袁宜先生自2012年10月12日起担任汉盛证券投资基金基金经理；2014年4月30日汉盛证券投资基金转型为富国天盛灵活配置混合型证券投资基金，袁宜先生继续担任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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自2014年1月1日至2014年4月29日作为原汉盛证券投资基金的管理人、自2014年4月30日至2014年6月30日作为转型后的富国天盛灵活配置混合型证券投资基金的管理人，分别按照转型前后的《汉盛证券投资基金基金合同》、《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，并严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》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，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

（1）自2014年1月1日至2014年4月29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，报告期内汉盛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14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4月30日至2014年6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，报告期内富国天盛灵活配置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4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

今年上半年，中国经济增速低位徘徊，消费、投资、出口都表现疲弱。在此背景下，3月以来，稳增长力度有所加强，财政货币政策偏于宽松。

上半年A股市场的表现也基本平稳，波幅几乎创下历史最低。而沪港通、新股发行等事件，曾给市场带来阶段性的冲击。期间，各类主题投资相对活跃。

本基金于2月中旬逐步减仓，一定程度上规避了之后成长股的回调。在4月底完成封转开、5月度过集中申购期以后，本基金逐步加仓，并在半年末保持了相对较高的仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年4月29日，汉盛证券投资基金份额净值为1.0081元。本报告期（2014年1月1日至2014年4月29日）份额净值增长率为-3.35%。

截至2014年6月30日，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金份额净值为

1.052 元，份额累计净值为 1.068 元。本报告期（2014 年 4 月 30 日至 2014 年 6 月 30 日）份额净值增长率为 6.77%，同期业绩比较基准收益率为 1.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，在四季度经济同比增速回升以前，流动性环境还将保持对 A 股有利的宽松格局，随着沪港通兑现的时点临近，低估值的蓝筹板块值得配置。

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

2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日，汉盛证券投资基金于 2014 年 3 月 19 日公告对 2013 年报告期内利润进行收益分配，每 10 份基金份额派发现金红利 2.06 元，共计派发现金红利 412,000,001.06 元。汉盛证券投资基金在本报告期内的利润分配已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

2014 年 4 月 30 日至 2014 年 6 月 30 日，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 转型前基金（原汉盛证券投资基金）半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：汉盛证券投资基金

报告截止日：2014年4月29日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年4月29日	上年度末 (2013年12月31日)
资 产:		
银行存款	180,315,651.58	43,030,384.32
结算备付金	12,459,802.02	27,355,569.61
存出保证金	1,972,773.43	3,123,524.39
交易性金融资产	1,818,273,790.43	2,229,595,717.79
其中：股票投资	1,007,692,357.13	1,587,339,546.39
基金投资	—	—
债券投资	810,581,433.30	642,256,171.40
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	—	175,600,000.00
应收证券清算款	3,055,795.96	23,565,225.76
应收利息	15,973,458.90	8,573,880.13
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	24.36
资产总计	2,032,051,272.32	2,510,844,326.36
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2014年4月29日	(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	10,528,810.69	—

应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	2,463,791.05	3,186,064.30
应付托管费	410,631.85	531,010.73
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	527,426.72	7,130,651.02
应交税费	1,478,558.72	1,478,558.72
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	500,409.72	592,000.00
负债合计	15,909,628.75	12,918,284.77
所有者权益：		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	16,141,643.57	497,926,041.59
所有者权益合计	2,016,141,643.57	2,497,926,041.59
负债和所有者权益总计	2,032,051,272.32	2,510,844,326.36

注：报告截止日 2014 年 04 月 29 日（基金合同终止日），基金份额净值 1.0081 元，基金份额总额 2,000,000,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：汉盛证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日)	上年度可比期间 (2013 年 01 月 01 日至 2013 年 06 月 30 日)
一、收入	-47,191,291.73	308,788,678.87
1. 利息收入	10,654,209.60	13,365,321.26
其中：存款利息收入	277,367.52	680,788.38
债券利息收入	9,893,456.45	10,254,077.53
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	483,385.63	2,430,455.35
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-17,007,723.55	388,609,521.27
其中：股票投资收益	-18,602,445.55	381,835,069.98
基金投资收益	—	—
债券投资收益	741,995.05	-1,130,187.95
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	852,726.95	7,904,639.24

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-40,837,777.78	-93,186,163.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	—	—
减：二、费用	22,593,105.23	43,923,894.54
1. 管理人报酬	11,682,183.28	17,599,387.74
2. 托管费	1,947,091.25	2,933,231.23
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	7,508,878.05	23,079,740.49
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	1,454,952.65	311,535.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-69,784,396.96	264,864,784.33
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-69,784,396.96	264,864,784.33

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汉盛证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年4月29日

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29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）	2,000,000,000.00	497,926,041.59	2,497,926,041.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-69,784,396.96	-69,784,396.96
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）	—	-412,000,001.06	-412,000,001.06
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	16,141,643.57	2,016,141,643.57
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）	2,000,000,000.00	175,911,856.39	2,175,911,856.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	264,864,784.33	264,864,784.33

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）	—	-76,000,000.59	-76,000,000.59
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	364,776,640.13	2,364,776,640.13

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

汉盛证券投资基金（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]13 号文《关于同意设立汉盛证券投资基金的批复》的核准，由富国基金管理有限公司、海通证券股份有限公司（原名为海通证券有限公司）、申银万国证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司（原名为江苏证券有限责任公司）、山东省国际信托有限公司（原名为山东省国际信托投资公司）、福建省投资开发集团有限责任公司（原名为福建国际信托投资公司）于 1999 年 5 月 10 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 20 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[99]27 号文审核同意，于 1999 年 5 月 18 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为中国境内上市的股票，债券及中国证监会批准的其他金融工具。本基金投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。本基金资产总值 80%以上投资于股票、债券市场，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，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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。

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1月1日至2014年4月29日的财务状况以及2014年1月1日至2014年4月29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[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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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，证券投资基金从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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2 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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司（“申银万国”）	基金管理人的股东、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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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4月29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	735,819,898.22	15.34	2,553,388,242.04	17.01
申银万国	138,457,431.54	2.89	1,344,453,201.79	8.95

6.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本期(2014年1月1日至2014年4月29日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年6月30日)均未与关联方进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 (2014年1月1日至2014年4月29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(%)
海通证券	—	—	15,998,474.20	16.58
申银万国	—	—	6,550,534.41	6.79

6.4.8.1.4 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4月29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(%)
海通证券	135,000,000.00	4.57	304,500,000.00	3.40
申银万国	340,000,000.00	11.52	1,333,000,000.00	14.87

6.4.8.1.5 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4月29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	662,906.60	15.45	5,826.10	1.11
申银万国	123,469.30	2.88	12,619.34	2.40
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	2,275,403.71	16.90	567,523.25	10.98
申银万国	1,215,880.60	9.03	388,077.75	7.51

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除由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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月 29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	11,682,183.28	17,599,387.74
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：该项费用按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提，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。计算方法如下：

$H = E * 1.50\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的管理人管理费

E 为前一日的基金资产净值(扣除超过规定比例现金后的资产净值)

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29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	1,947,091.25	2,933,231.23

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：

$$H = E * 0.25\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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4月29日)	上年度可比期间(2013年01月01日至2013年06月30日)
基金转型日1999年05月10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
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.50%	0.50%

6.4.8.4.2 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4月29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(%)
申银万国证券股份有限公司	10,000,000.00	0.50	10,000,000.00	0.50
海通证券股份有限公司	5,000,000.00	0.25	5,000,000.00	0.25
山东省国际信托有	5,000,000.00	0.25	5,000,000.00	0.25

限公司				
-----	--	--	--	--

6.4.8.5 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1月1日至2014年4月29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
中国农业银行股份有限公司	180,315,651.58	202,667.75	186,348,591.11	496,915.19

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末(2014年4月29日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.9.2 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
000712	锦龙股份	2014-03-31	问题核查	26.79	2014-05-14	24.21	2,839,429	82,698,795.25	76,068,302.91	—
000748	长城信息	2014-04-21	筹划重大事项	23.36	2014-05-13	24.60	747,867	14,714,640.02	17,470,173.12	—
000801	四川九洲	2014-04-14	筹划重大事项	15.30	2014-05-30	16.83	40,726	595,185.15	623,107.80	—
002405	四维图新	2014-02-28	筹划重大事项	15.43	2014-05-22	16.92	2,546,738	39,653,449.14	39,296,167.34	—
002520	日发精机	2014-03-18	筹划重大事项	26.44	2014-05-12	23.80	2,082,214	45,991,698.47	55,053,738.16	—
300085	银之杰	2014-01-23	筹划重大事项	14.75	2014-05-23	13.30	5,065,222	43,807,264.59	74,712,024.50	—
300088	长信科技	2014-03-13	筹划重大事项	19.59	2014-07-01	18.00	366,450	8,026,990.26	7,178,755.50	—
300323	华灿光电	2014-04-28	筹划重大事项	18.68	2014-07-28	11.21	422,257	7,431,672.63	7,887,760.76	—
600089	特变电工	2014-04-28	筹划重大事项	8.87	2014-04-30	9.02	1,418,860	13,758,829.20	12,585,288.20	—

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.10 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 转型后基金（富国天盛灵活配置混合型证券投资基金）半年度财务报表 (未经审计)

7.1 资产负债表

会计主体：富国天盛灵活配置混合型证券投资基金

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)
资产：	
银行存款	80,877,053.21
结算备付金	9,445,531.90
存出保证金	1,472,673.64
交易性金融资产	1,624,010,443.79
其中：股票投资	1,522,465,854.29
基金投资	—
债券投资	101,544,589.50
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	32,536,078.02
应收利息	2,096,087.69
应收股利	—
应收申购款	100,985.22
递延所得税资产	—
其他资产	7,914.39
资产总计	1,750,546,767.86
负债和所有者权益	本期末

	(2014年06月30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	—
应付赎回款	2,275,243.77
应付管理人报酬	2,176,092.50
应付托管费	362,682.08
应付销售服务费	—
应付交易费用	3,428,069.63
应交税费	1,478,558.72
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	450,297.51
负债合计	10,170,944.21
所有者权益:	
实收基金	1,629,651,118.37
未分配利润	110,724,705.28
所有者权益合计	1,740,375,823.65
负债和所有者权益总计	1,750,546,767.86

注：报告截止日 2014 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.052 元，基金份额总额 1,653,976,030.52 份。

7.2 利润表

会计主体：富国天盛灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 4 月 30 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2014 年 4 月 30 日(基金转型日)至 2014 年 6 月 30 日
一、收入	105,755,274.35
1. 利息收入	2,268,032.57
其中：存款利息收入	546,687.10
债券利息收入	1,547,982.57
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	173,362.90
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	17,717,812.04

其中：股票投资收益	13,408,673.68
基金投资收益	—
债券投资收益	-909,285.41
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	5,218,423.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	82,595,481.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	3,173,948.33
减：二、费用	10,243,453.87
1. 管理人报酬	4,701,492.52
2. 托管费	783,840.32
3. 销售服务费	—
4. 交易费用	4,690,061.50
5. 利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 其他费用	68,059.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	95,511,820.48
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	95,511,820.48

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天盛灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014年4月30日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年6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）	2,000,000,000.00	16,141,643.57	2,016,141,643.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	95,511,820.48	95,511,820.48
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）	-370,348,881.63	-928,758.77	-371,277,640.40
其中：1. 基金申购款	111,481,134.99	1,728,441.19	113,209,576.18
2. 基金赎回款	-481,830,016.62	-2,657,199.96	-484,487,216.58
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）	1,629,651,118.37	110,724,705.28	1,740,375,823.65

注：，本期财务报表的实际编制期间系 2014 年 4 月 30 日（基金转型日）起至 2014 年 6 月 30 日止。

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
基金管理人负责人	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 基金基本情况

富国天盛灵活配置混合型证券投资基金由汉盛证券投资基金转型而来。2014 年 3 月 6 日至 2014 年 4 月 8 日，汉盛证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开。基金管理人于 2014 年 4 月 22 日收到中国证券监督管理委员会证券投资基金机构监管部部函[2014]67 号《关于汉盛证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》。依据汉盛证券投资基金持有人大会决议，基金管理人向上海证券交易所申请汉盛证券投资基金终止上市，并已获得同意上海证券交易所自律监管决定书[2014]172 号文，自汉盛证券投资基金终止上市之日（2014 年 4 月 30 日）起，原《汉盛证券投资基金基金合同》终止，《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为不定期，基金投资目标，范围策略略作调整同时基金更名为“富国天盛灵活配置混合型证券投资基金”。根据安永华明(2014)验字第 60467606_B06 号验资报告，截至 2014 年 6 月 4 日止，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金已收到集中申购款（扣除申购费后）的实收基金（本金）为人民币 108,841,235.65 元，折合 108,841,235.65 份基金份额。集中申购款在集中申购期间产生的利息为人民币 7,914.39 元，折合 7,914.39 份基金份额。以上收到的实收基金（本息）共计人民币 108,849,150.04 元，折合 108,849,150.04 份基金份额。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

7.4.2 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。

7.4.3 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 4 月 30 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2014 年 4 月 30 日起至 2014 年 6 月 30 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另

一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，起按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；买入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；

卖出债券于成交日确认债券投资收益；

卖出债券的成本按移动加权平均法结转

(3) 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扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，应按中国证监会相关规定处理。

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据

表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；
(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，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；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

- (5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;
- (6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认债券投资收益/(损失),并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;
- (7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;
- (8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;
- (9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;
- (10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提;
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提;
- (3) 卖出回购证券支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;
- (4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次;若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;基金合同生效满 3 个月后,若基金在每季度最后一个自然日收盘后每 10 份基金份额可供分配利润金额高于 0.1 元(含),则本基金须在 10 个工作日之内进行收益分配;
- (2) 每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%;
- (3) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;
- (4) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值
- (5) 每一基金份额享有同等分配权;
- (6) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本期未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。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。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。

7.4.7 关联方关系

7.4.7.1 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

本期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

7.4.7.2 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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司（“申银万国”）	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 4 月 30 日(基金转型日)至 2014 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额 的比例 (%)
海通证券	897,765,528.54	27.64

注：本基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。

7.4.8.1.2 权证交易

注：1、本基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。

2、本基金本期（2014 年 4 月 30 日至 2014 年 6 月 30 日）未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

注：1、本基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。

2、本基金本期（2014 年 4 月 30 日至 2014 年 6 月 30 日）未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 4 月 30 日(基金转型日)至 2014 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成交总 额的比例 (%)
海通证券	60,000,000.00	12.24

注：本基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。

7.4.8.1.5 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4月30日(基金转型日)至2014年6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	798,822.26	27.58	798,822.26	27.58

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，扣除由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。

2、本基金转型日为2014年4月30日。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,701,492.52
其中：支付销售机构的客户维护费	50,834.18

注：基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	783,840.32

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 4 月 30 日(基金转型日)至 2014 年 6 月 30 日
基金转型日(2014 年 04 月 30 日)持有的基金份额	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	149,094.02
减: 期间赎回/卖出总份额	—
期末持有的基金份额	10,149,094.02
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.61%

注: 本基金转型日为 2014 年 04 月 30 日。本基金管理人持有本基金份额由原汉盛证券投资基金转型而来。

7.4.8.4.2 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)	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
申银万国证券股份有限公司	10,149,094.03	0.61
山东省国际信托有限公司	5,074,547.01	0.31

注: 本基金转型日为 2014 年 04 月 30 日。本基金管理人持有本基金份额由原汉盛证券投资基金转型而来。

7.4.8.5 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 4 月 30 日(基金转型日)至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	80,877,053.21	522,199.99

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联方交易事项。

7.4.9 期末（2014年06月30日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.9.1.1 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
002727	一心堂	2014-06-25	2014-07-02	新股认购	12.20	12.20	4,484	54,704.80	54,704.80	—
603328	依顿电子	2014-06-23	2014-07-01	新股认购	15.31	15.31	31,770	486,398.70	486,398.70	—

7.4.9.2 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
002340	格林美	2014-06-26	筹划重大事项	11.19	2014-07-24	11.77	294,496	3,355,593.10	3,295,410.24	—
300088	长信科技	2014-03-13	筹划重大事项	19.49	2014-07-01	18.00	366,450	8,026,990.26	7,142,110.50	—
300137	先河环保	2014-06-16	筹划重大事项	20.86	2014-08-15	14.31	562,688	11,809,604.06	11,737,671.68	—
300323	华灿光电	2014-04-28	筹划重大事项	18.68	2014-07-28	11.21	422,257	7,431,672.63	7,887,760.76	—

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.10 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。

§8 转型前基金（原汉盛证券投资基金）投资组合报告

8.1 转型前最后一日基金资产组合情况

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	1,007,692,357.13	49.59
	其中：股票	1,007,692,357.13	49.59

2	固定收益投资	810,581,433.30	39.89
	其中：债券	810,581,433.30	39.89
	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	—	—
	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	192,775,453.60	9.49
7	其他各项资产	21,002,028.29	1.03
8	合计	2,032,051,272.32	100.00

注：转型前最后一日为2014年4月29日。

8.2 转型前最后一日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	3,746,979.00	0.19
B	采矿业	2,746,140.80	0.14
C	制造业	637,125,968.68	31.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,068,302.91	3.77
E	建筑业	41,842,710.00	2.08
F	批发和零售业	9,234,201.04	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	128,090,197.65	6.35
J	金融业	—	—
K	房地产业	104,881,479.45	5.20
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	3,956,377.60	0.20
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,007,692,357.13	49.98

注：转型前最后一日为2014年4月29日。

8.3 转型前最后一日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

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	7,832,593	186,259,061.54	9.24
2	000712	锦龙股份	2,839,429	76,068,302.91	3.77
3	300085	银之杰	5,065,222	74,712,024.50	3.71
4	002520	日发精机	2,082,214	55,053,738.16	2.73
5	600340	华夏幸福	1,599,376	40,640,144.16	2.02
6	002405	四维图新	2,546,738	39,296,167.34	1.95
7	300129	泰胜风能	3,078,818	37,869,461.40	1.88
8	600584	长电科技	4,880,428	36,310,384.32	1.80
9	002415	海康威视	1,813,110	33,433,748.40	1.66
10	000961	中南建设	4,755,172	32,144,962.72	1.59

注：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文

8.4 期初至转型前最后一日（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日）股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600584	长电科技	102,385,791.15	4.10
2	000712	锦龙股份	86,261,444.93	3.45
3	300266	兴源过滤	72,532,570.16	2.90
4	300129	泰胜风能	69,295,085.80	2.77
5	000961	中南建设	59,030,050.98	2.36
6	300183	东软载波	52,852,250.45	2.12
7	002520	日发精机	49,173,510.52	1.97
8	002586	围海股份	48,996,823.47	1.96
9	600340	华夏幸福	48,774,060.18	1.95
10	002405	四维图新	46,186,964.75	1.85
11	600563	法拉电子	44,963,339.86	1.80
12	600894	广日股份	44,947,558.37	1.80
13	002440	闰土股份	44,021,493.68	1.76
14	000801	四川九洲	43,444,190.75	1.74
15	002415	海康威视	40,490,120.42	1.62
16	600685	广船国际	40,064,972.19	1.60
17	000671	阳光城	39,921,803.44	1.60
18	601933	永辉超市	36,235,176.59	1.45
19	000997	新大陆	35,479,191.75	1.42
20	002206	海利得	34,988,537.41	1.40

注：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。“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。

8.4.2 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	000423	东阿阿胶	127,522,191.32	5.11
2	600060	海信电器	116,274,102.30	4.65
3	600859	王府井	92,062,391.41	3.69
4	600584	长电科技	86,408,685.10	3.46
5	600703	三安光电	68,224,688.61	2.73
6	000651	格力电器	62,223,820.07	2.49
7	601607	上海医药	60,115,227.20	2.41
8	300266	兴源过滤	57,238,996.54	2.29
9	600649	城投控股	55,061,148.43	2.20
10	600894	广日股份	54,772,522.18	2.19
11	600066	宇通客车	51,690,236.61	2.07
12	002214	大立科技	50,029,133.59	2.00
13	600761	安徽合力	49,713,231.35	1.99
14	000801	四川九洲	43,298,083.05	1.73
15	300253	卫宁软件	43,057,498.59	1.72
16	002586	围海股份	41,863,920.13	1.68
17	600685	广船国际	39,619,197.06	1.59
18	600171	上海贝岭	38,677,567.43	1.55
19	002049	同方国芯	38,238,509.62	1.53
20	300183	东软载波	38,131,572.12	1.53

注：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。“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。

8.4.3 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	2,143,000,019.82
卖出股票收入（成交）总额	2,657,542,608.90

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。

8.5 转型前最后一日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	8,791,200.00	0.44
2	央行票据	—	—
3	金融债券	783,906,000.00	38.88
	其中：政策性金融债	783,906,000.00	38.88
4	企业债券	17,679,941.10	0.88
5	企业短期融资券	—	—

6	中期票据	—	—
7	可转债	204,292.20	0.01
8	其他	—	—
9	合计	810,581,433.30	40.20

注：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。

8.6 转型前最后一日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	140317	14 进出 17	1,000,000	99,880,000.00	4.95
2	130227	13 国开 27	800,000	79,976,000.00	3.97
3	090304	09 进出 04	700,000	69,944,000.00	3.47
4	130236	13 国开 36	600,000	60,042,000.00	2.98
5	130428	13 农发 28	500,000	50,110,000.00	2.49

注：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。

8.7 转型前最后一日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 转型前最后一日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：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 转型前最后一日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：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。本基金本报告期末未持有权证。

8.10 转型前最后一日本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 转型前最后一日本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 期初至转型前最后一日（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日）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。

8.11 转型前最后一日本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 期初至转型前最后一日（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日）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。

8.11.2 转型前最后一日本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 期初至转型前最后一日（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日）国债期货投资评价

转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

本报告期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。

8.12.3 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	1,972,773.43
2	应收证券清算款	3,055,795.96
3	应收股利	—
4	应收利息	15,973,458.90
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	21,002,028.29

注：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。

8.12.4 转型前最后一日持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113003	重工转债	9,510.30	0.00
2	110015	石化转债	3,078.30	0.00

注：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。

8.12.5 转型前最后一日前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000712	锦龙股份	76,068,302.91	3.77	问题核查
2	300085	银之杰	74,712,024.50	3.71	筹划重大事项
3	002520	日发精机	55,053,738.16	2.73	筹划重大事项
4	002405	四维图新	39,296,167.34	1.95	筹划重大事项

注：转型前最后一日为 2014 年 4 月 29 日。

8.12.6 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。

§ 9 转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金投资组合报告

9.1 2014 年 6 月 30 日基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
9	权益投资	1,522,465,854.29	86.97
	其中：股票	1,522,465,854.29	86.97
10	固定收益投资	101,544,589.50	5.80
	其中：债券	101,544,589.50	5.80
	资产支持证券	—	—
11	贵金属投资	—	—
12	金融衍生品投资	—	—
13	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
14	银行存款和结算备付金合计	90,322,585.11	5.16
15	其他各项资产	36,213,738.96	2.07
16	合计	1,750,546,767.86	100.00

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。

9.2 2014 年 6 月 30 日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	19,946,067.62	1.15
B	采矿业	12,863,031.80	0.74
C	制造业	785,977,907.56	45.16

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	5,218,456.03	0.30
F	批发和零售业	7,394,978.80	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	30,562,298.54	1.76
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	396,955,728.81	22.81
J	金融业	64,289,322.60	3.69
K	房地产业	123,223,618.87	7.08
L	租赁和商务服务业	9,116,330.76	0.52
M	科学研究和技术服务业	895,215.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	26,187,962.10	1.50
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	15,006,910.30	0.86
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	24,828,025.50	1.43
S	综合	—	—
	合计	1,522,465,854.29	87.48

注：基金转型日为2014年4月30日。

9.3 2014年6月30日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

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	2,949,364	69,103,598.52	3.97
2	300129	泰胜风能	4,198,036	56,883,387.80	3.27
3	300085	银之杰	3,168,776	54,851,512.56	3.15
4	000712	锦龙股份	3,533,426	52,754,050.18	3.03
5	600340	华夏幸福	1,898,929	47,796,042.93	2.75
6	000671	阳光城	5,429,270	47,723,283.30	2.74
7	002153	石基信息	888,313	45,570,456.90	2.62
8	300170	汉得信息	3,143,468	40,550,737.20	2.33
9	002085	万丰奥威	1,695,442	36,045,096.92	2.07
10	002475	立讯精密	1,019,389	33,415,571.42	1.92

注：基金转型日为2014年4月30日。

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文

9.4 转型日至报告期末（2014年4月30日至2014年6月30日）股票投资组合的重大变动

9.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300129	泰胜风能	59,364,610.59	3.41
2	300170	汉得信息	56,727,169.03	3.26
3	600089	特变电工	52,340,946.82	3.01
4	002153	石基信息	42,639,073.22	2.45
5	002008	大族激光	41,018,540.97	2.36
6	300212	易华录	33,881,406.38	1.95
7	000559	万向钱潮	33,240,825.17	1.91
8	002594	比亚迪	33,136,577.71	1.90
9	002085	万丰奥威	31,978,446.26	1.84
10	300010	立思辰	31,472,380.55	1.81
11	601333	广深铁路	31,157,258.61	1.79
12	300115	长盈精密	29,366,127.63	1.69
13	002421	达实智能	28,936,388.11	1.66
14	601231	环旭电子	28,842,374.60	1.66
15	002049	同方国芯	28,482,807.87	1.64
16	300133	华策影视	28,035,846.39	1.61
17	000002	万科A	27,038,192.46	1.55
18	300287	飞利信	26,924,702.44	1.55
19	002475	立讯精密	26,411,189.06	1.52
20	300090	盛运股份	26,151,947.82	1.50

注：基金转型日为2014年4月30日。“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。

9.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600703	三安光电	112,325,655.16	6.45
2	600089	特变电工	64,526,257.21	3.71
3	300085	银之杰	48,174,707.44	2.77
4	002405	四维图新	44,098,006.62	2.53
5	600887	伊利股份	38,835,268.59	2.23
6	002415	海康威视	37,814,325.98	2.17
7	300129	泰胜风能	36,853,190.23	2.12
8	000712	锦龙股份	33,864,960.92	1.95
9	002382	蓝帆股份	27,849,131.93	1.60
10	000961	中南建设	27,553,219.96	1.58
11	002030	达安基因	27,145,339.20	1.56
12	002440	闰土股份	24,083,197.30	1.38
13	000002	万科A	22,560,049.88	1.30
14	002049	同方国芯	22,552,572.31	1.30
15	600312	平高电气	22,299,357.35	1.28

16	000333	美的集团	22,271,651.26	1.28
17	300024	机器人	21,994,427.92	1.26
18	002368	太极股份	21,958,085.83	1.26
19	300287	飞利信	21,760,341.43	1.25
20	300115	长盈精密	20,683,119.49	1.19

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。“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。

9.4.3 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	1,835,090,617.98
卖出股票收入（成交）总额	1,413,931,275.10

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。

9.5 2014 年 6 月 30 日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	8,870,400.00	0.51
2	央行票据	—	—
3	金融债券	78,096,000.00	4.49
	其中：政策性金融债	78,096,000.00	4.49
4	企业债券	14,578,189.50	0.84
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	101,544,589.50	5.83

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。

9.6 2014 年 6 月 30 日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	140316	14 进出 16	500,000	48,960,000.00	2.81
2	110226	11 国开 26	300,000	29,136,000.00	1.67
3	122009	08 新潮债	144,410	14,578,189.50	0.84
4	010107	21 国债(7)	88,000	8,870,400.00	0.51

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。

9.7 2014 年 6 月 30 日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。本基金本报告期末未持有资产支持证券。

9.8 2014年6月30日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：基金转型日为2014年4月30日。本基金本报告期末未持有贵金属投资。

9.9 2014年6月30日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：基金转型日为2014年4月30日。本基金本报告期末未持有权证。

9.10 2014年6月30日本基金投资的股指期货交易情况说明

9.10.1 2014年6月30日本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：基金转型日为2014年4月30日。本基金本报告期末未投资股指期货。

9.10.2 转型日至报告期末（2014年4月30日至2014年6月30日）本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

9.11 2014年6月30日本基金投资的国债期货交易情况说明

9.11.1 转型日至报告期末（2014年4月30日至2014年6月30日）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。

9.11.2 2014年6月30日本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：基金转型日为2014年4月30日。本基金本报告期末未投资国债期货。

9.11.3 转型日至报告期末（2014年4月30日至2014年6月30日）国债期货投资评价

基金转型日为2014年4月30日。本基金本报告期末未投资国债期货。

9.12 投资组合报告附注

9.12.1 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。

9.12.2 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。

本报告期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。

9.12.3 2014年6月30日其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,472,673.64
2	应收证券清算款	32,536,078.02
3	应收股利	—
4	应收利息	2,096,087.69
5	应收申购款	100,985.22
6	其他应收款	7,914.39
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	36,213,738.96

注：基金转型日为2014年4月30日。

9.12.4 2014年6月30日持有的处于转股期的可转换债券明细

注：基金转型日为2014年4月30日。本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

9.12.5 2014年6月30日前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：基金转型日为2014年4月30日。本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

9.12.6 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。

§ 10 转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人信息

10.1 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	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
4413	374,796.29	797,992,593.87	48.25	855,983,436.65	51.75

注：基金转型日为2014年4月30日

10.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员	29,744.31	0.0018

持有本基金		
-------	--	--

10.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 11 转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金开放式基金份额变动

单位：份

基金转型日 2014 年 4 月 30 基金份额总额	2,000,000,000.00
基金转型日 2014 年 4 月 30 日起至报告期期末基金总申 购份额	113,134,971.31
减：基金转型日 2014 年 4 月 30 日起至报告期期末基金 总赎回份额	484,513,881.62
基金转型日 2014 年 4 月 30 日起至报告期期末基金拆分 变动份额	25,354,940.83
本报告期期末基金份额总额	1,653,976,030.52

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 12 重大事件揭示

12.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，汉盛证券投资基金自 2014 年 3 月 6 日至 2014 年 4 月 8 日以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于汉盛证券投资基金转型有关事项的议案》。本次会议结果已经中国证券监督管理委员会备案（证券基金机构监管部函[2014]67 号），会议决议已生效。

自 2014 年 4 月 30 日（汉盛证券投资基金终止上市之日）起，由《汉盛证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《汉盛证券投资基金基金合同》自同日起失效。

12.2 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。

12.3 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。

12.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金转型后，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金与原汉盛证券投资基金相比，在投资目标、投资范围、投资策略等方面均有调整。

12.5 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。

12.6 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、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

12.7 转型前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 (%)	
银河证券	1	157,925,602.81	3.29	—	—	224,000,000.00	7.59	—	—	143,774.54	3.35	—
财富里昂	2	950,235,106.57	19.81	—	—	145,000,000.00	4.91	—	—	844,410.56	19.68	—
齐鲁证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国海证券	2	908,849,722.16	18.94	—	—	670,000,000.00	22.70	—	—	814,943.39	18.99	—
国信证券	1	73,250,742.35	1.53	—	—	56,000,000.00	1.90	—	—	66,687.18	1.55	—
招商证券	2	98,678,689.22	2.06	—	—	—	—	—	—	88,824.25	2.07	—
海通证券	2	735,819,898.22	15.34	—	—	135,000,000.00	4.57	—	—	662,906.60	15.45	—
国金证券	2	736,719,756.50	15.36	—	—	402,000,000.00	13.62	—	—	651,723.92	15.19	—
申银万国	2	138,457,431.54	2.89	—	—	340,000,000.00	11.52	—	—	123,469.30	2.88	—
光大证券	1	229,290,315.84	4.78	—	—	810,000,000.00	27.44	—	—	208,743.40	4.86	—
国泰君安	2	360,031,737.72	7.50	—	—	170,000,000.00	5.76	—	—	324,424.67	7.56	—
安信证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
太平洋证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华泰证券	1	408,356,082.29	8.51	—	—	—	—	—	—	361,354.35	8.42	—

注：1. 我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. 本基金本期（2014年1月1日至2014年4月29日）租用的券商交易单元未发生变更。

12.8 转型后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 (%)	
华泰证券	1	820,812,224.42	25.27	—	—	—	—	—	—	726,338.65	25.08	—
光大证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
民族证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	1	113,503,447.49	3.49	—	—	—	—	—	—	103,333.11	3.57	—
齐鲁证券	1	282,333,520.02	8.69	2,640,456.74	81.47	150,000,000.00	30.61	—	—	257,039.25	8.87	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申银万国	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
安信证券	2	84,335,246.64	2.60	—	—	—	—	—	—	74,628.28	2.58	—
海通证券	2	897,765,528.54	27.64	—	—	60,000,000.00	12.24	—	—	798,822.26	27.58	—
财富里昂	2	213,025,007.41	6.56	—	—	—	—	—	—	188,505.77	6.51	—
国海证券	2	356,815,120.68	10.98	437,325.63	13.49	—	—	—	—	317,641.49	10.97	—
银河证券	1	208,854,027.81	6.43	—	—	280,000,000.00	57.14	—	—	190,140.80	6.56	—
国金证券	2	224,249,032.74	6.90	163,397.10	5.04	—	—	—	—	198,691.28	6.86	—

招商证券	2	46,532,989.01	1.43	-	-	-	-	-	-	41,177.02	1.42	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1. 我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. 本基金本期（2014年4月30日至2014年6月30日）租用券商交易单元的变更情况：新增民族证券 394615、民族证券 28815 席位。

