

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

二〇一三年半年度报告

2013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： 中国工商银行股份有限公司

送出日期： 2013年08月29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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 27 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 2013 年 1 月 1 日起至 2013 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	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
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情况.....	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.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	13
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.....	13
§6	半年度财务报表(未经审计).....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	16

6.4	报表附注.....	17
§7	投资组合报告.....	34
7.1	期末基金资产组合情况.....	34
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6	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.....	45
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	46
7.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.10	投资组合报告附注.....	46
§8	基金份额持有人信息.....	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
§9	开放式基金份额变动.....	48
§10	重大事件揭示.....	49
10.1	基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4	基金投资策略的改变.....	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8	其他重大事件.....	51
§11	备查文件目录.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证综指交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	富国上证综指 ETF
基金主代码	510210
交易代码	510210
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2011年01月30日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	143,138,513.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011年3月25日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数（上证综合指数），追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	上证综合指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国工商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	范伟隽	赵会军
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	95105686、4008880688	95588	
传真	021-20361616	010—66105798	
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楼	北京市西城区复兴门内大街 55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楼	北京市西城区复兴门内大街 55号	
邮政编码	200120	100140	
法定代表人	陈敏	姜建清	

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、证券时报
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楼 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年01月01日至2013年06月30日)
本期已实现收益	-6,306,825.57
本期利润	-41,726,965.89
加权平均基金份额本期利润	-0.2813
本期加权平均净值利润率	-12.00%
本期基金份额净值增长率	-12.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年06月30日)
期末可供分配利润	-122,638,199.56
期末可供分配基金份额利润	-0.8568
期末基金资产净值	295,612,107.55
期末基金份额净值	2.065
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-29.33%

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，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。

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）。

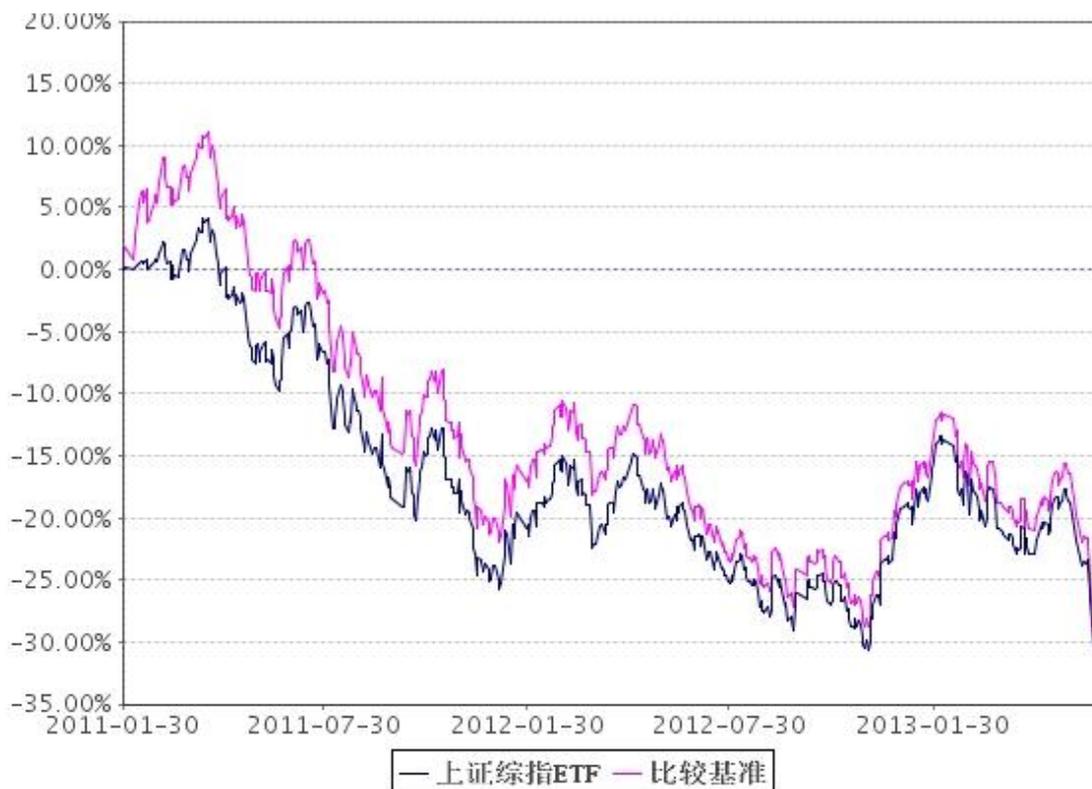
3.2 基金净值表现

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	-13.09%	1.58%	-13.97%	1.54%	0.88%	0.04%

过去三个月	-10.72%	1.21%	-11.51%	1.20%	0.79%	0.01%
过去六个月	-12.39%	1.26%	-12.78%	1.24%	0.39%	0.02%
过去一年	-9.98%	1.16%	-11.06%	1.15%	1.08%	0.01%
自基金合同生效日起至今	-29.33%	1.12%	-28.10%	1.14%	-1.23%	-0.02%

3.2.2 自基金成立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 2013 年 6 月 30 日。

本基金建仓期 3 个月，即从 2011 年 1 月 30 日起至 2011 年 4 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情况

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。截止2013年6月30日，本基金管理人共管理汉盛证券投资基金、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、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三十七只证券投资基金。

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		
王保合	本基金基金经理兼任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理	2011-03-03	—	8年	博士，曾任富国基金管理有限公司研究员；富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理；2011年3月起任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基金经理；具有基金从业资格，中国国籍。

注：上述表格内基金经理的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。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。

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上证综指交易型开放式指数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》、《上证综指交易型开放式指数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，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，亦未受到监管机构的相关调查。

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

在基金投资管理上，我们坚持采取量化策略进行指数跟踪和风险管理，虽然报告期内市场较大波动，我们的基金跟踪误差一直保持在较低水平，年化跟踪误差只有1.56%。

回顾2013年上半年，国内经济呈现弱复苏态势，上半年GDP增长率下降到7.6%，投资者对于经济增长的前景较为悲观，认为经济增长率的中枢可能长期呈现下降趋势。资本市场上的资产表现呈现两极分化趋势。一方面，代表经济增长大方向的大盘蓝筹股表现低迷，资金纷纷从中撤出；另一方面，代表新兴行业的创业板股票表现强劲，年初以来创业板指数已经上涨超过40%。资金明显更加偏向于更具增长潜力的新兴行业。整个上半年，上证综指呈现出先扬后抑的走势，整体下跌12.78%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日，本基金份额净值为2.065元，份额累计净值为0.707元。报告期内，本基金份额净值增长率为-12.39%，同期业绩比较基准收益率为-12.78%。

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 2013 年下半年，随着新一届政府对经济改革的进一步深化，传统周期性行业可能仍然维持弱复苏的状态，成长性确定的新兴行业可能会继续受到市场的追捧。不过，随着 IPO 重新放开，之前对于市场的不利因素已基本释放完毕，目前市场的估值也基本反映了这些悲观预期，投资者将从之前的悲观情绪中逐渐恢复，估计市场在下半年会呈现震荡向上走势。

在投资管理上，我们将继续发挥量化团队优势，以获取更好的业绩回报投资者。

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投资基金行业从业经验。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

本报告期内，本基金托管人在对上证综指交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，上证综指交易型开放式指数证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在上证综指交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，上证综指交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的上证综指交易型开放式指数证券投资基金 2013 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2013 年 8 月 27 日

§ 6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2013 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2013 年 06 月 30 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)
资产：		
银行存款	3,727,905.38	2,985,413.35
结算备付金	12,169.88	20.21
存出保证金	3,484.52	—
交易性金融资产	289,691,219.29	357,274,159.20
其中：股票投资	289,691,219.29	357,274,159.20
基金投资	—	—

债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	31,979.50
应收利息	696.65	656.48
应收股利	2,585,442.16	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	296,020,917.88	360,292,228.74
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2013年06月30日)	(2012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	—	134.72
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	130,799.74	158,398.40
应付托管费	26,159.95	31,679.70
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	43,166.13	436.65
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	208,684.51	312,370.50

负债合计	408,810.33	503,019.97
所有者权益：		
实收基金	418,250,307.11	446,009,278.76
未分配利润	-122,638,199.56	-86,220,069.99
所有者权益合计	295,612,107.55	359,789,208.77
负债和所有者权益总计	296,020,917.88	360,292,228.74

注：报告截止日 2013 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.065 元，基金份额总额 143,138,513.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2013 年 01 月 01 日至 2013 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2013 年 01 月 01 日 至 2013 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2012 年 01 月 01 日至 2012 年 06 月 30 日)
一、收入	-40,359,022.90	15,499,308.02
1. 利息收入	8,450.69	9,912.08
其中：存款利息收入	8,450.69	9,784.61
债券利息收入	—	127.47
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-4,947,410.27	-8,110,998.61
其中：股票投资收益	-9,954,619.50	-14,566,903.14
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	42,370.83
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—

股利收益	5,007,209.23	6,413,533.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-35,420,140.32	23,601,692.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	77.00	-1,297.99
减：二、费用	1,367,942.99	1,614,518.08
1. 管理人报酬	863,997.85	1,060,125.54
2. 托管费	172,799.63	212,025.09
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	72,231.50	71,921.75
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	258,914.01	270,445.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-41,726,965.89	13,884,789.94
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-41,726,965.89	13,884,789.94

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2013年01月01日至2013年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (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）	446,009,278.76	-86,220,069.99	359,789,208.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	—	-41,726,965.89	-41,726,965.89
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)	-27,758,971.65	5,308,836.32	-22,450,135.33

其中：1. 基金申购款	13,148,986.54	-2,667,346.42	10,481,640.12
2. 基金赎回款	-40,907,958.19	7,976,182.74	-32,931,775.45
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）	418,250,307.11	-122,638,199.56	295,612,107.55
项目	上年度可比期间 (2012年01月01日至2012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）	533,669,188.85	-127,653,772.31	406,015,416.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	13,884,789.94	13,884,789.94
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）	-8,765,991.05	999,961.45	-7,766,029.60
其中：1. 基金申购款	20,453,979.07	-3,953,240.77	16,500,738.30
2. 基金赎回款	-29,219,970.12	4,953,202.22	-24,266,767.90
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）	524,903,197.80	-112,769,020.92	412,134,176.88

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：

陈敏

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证综指交易型开放式指数证券投资基金（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”）证监许可[2010]1379号《关于核准上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集，基金合同于2011年1月30日正式生效，首次设立募集规模为320,363,407.00份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

本基金业绩比较基准为标的指数。

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2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至2013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（2013 年 06 月 30 日）
活期存款	3,727,905.38
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计	3,727,905.38

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2013 年 06 月 30 日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	387,894,694.88	289,691,219.29	-98,203,475.59
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—

	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
	合计	387,894,694.88	289,691,219.29	-98,203,475.59

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

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（2013年06月30日）
应收活期存款利息	689.55
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	5.50
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
其他	1.60
合计	696.65

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（2013年06月30日）
交易所市场应付交易费用	43,166.13

银行间市场应付交易费用	—
合计	43,166.13

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2013年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提上市年费	29,752.78
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	104,136.54
应付指数使用费	50,000.00
合计	208,684.51

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	152,638,513.00	446,009,278.76
本期申购	4,500,000.00	13,148,986.54
本期赎回（以“-”号填列）	-14,000,000.00	-40,907,958.19
本期末	143,138,513.00	418,250,307.11

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	-39,989,557.95	-46,230,512.04	-86,220,069.99
本期利润	-6,306,825.57	-35,420,140.32	-41,726,965.89
本期基金份额交易产生的变动数	2,947,064.79	2,361,771.53	5,308,836.32
其中：基金申购款	-1,320,806.35	-1,346,540.07	-2,667,346.42
基金赎回款	4,267,871.14	3,708,311.60	7,976,182.74

本期已分配利润	—	—	—
本期末	-43,349,318.73	-79,288,880.83	-122,638,199.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
活期存款利息收入	8,037.05
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	402.67
其他	10.97
合计	8,450.69

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,720,323.16
股票投资收益——赎回差价收入	-5,234,296.34
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	-9,954,619.50

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
卖出股票成交总额	23,573,757.86
减：卖出股票成本总额	28,294,081.02
买卖股票差价收入	-4,720,323.16

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
----	-----------------------------

赎回基金份额对价总额	32,931,775.45
减：现金支付赎回款总额	381,804.45
减：赎回股票成本总额	37,784,267.34
赎回差价收入	-5,234,296.34

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成交总额	—
减：卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成本总额	—
减：应收利息总额	—
债券投资收益	—

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无权证投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
股票投资产生的股利收益	5,007,209.23
基金投资产生的股利收益	—
合计	5,007,209.23

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
1. 交易性金融资产	-35,420,140.32
股票投资	-35,420,140.32
债券投资	—
资产支持证券投资	—

基金投资	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
合计	-35,420,140.32

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
基金赎回费收入	—
替代损益	77.00
合计	77.00

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
交易所市场交易费用	72,231.50
银行间市场交易费用	—
合计	72,231.50

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
审计费用	24,795.19
信息披露费	104,136.54
银行汇划费用	229.50
指数使用费	100,000.00
上市费	29,752.78
合计	258,914.01

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

本期内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、基金销售机构
富国上证综指交易型开放式指数证券投资 基金联接基金	本基金的联接基金
中国工商银行股份有限公司	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。

6.4.10 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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（2013年01月01日至 2013年06月30日）	上年度可比期间（2012年01月 01日至2012年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	863,997.85	1,060,125.54
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：本基金的管理费按该基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

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

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（2013年01月01日至 2013年06月30日）	上年度可比期间（2012年01月 01日至2012年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	172,799.63	212,025.09

注：本基金的托管费按基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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（2013年06月30日）		上年度末（2012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(%)
富国上证综指交易 型开放式指数证券 投资基金联接基金	128,121,447.00	89.51	135,621,447.00	88.85

注：于本报告期末，富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金投资本基金的份额，适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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(2013年01月01日至2013年06月30日)		上年度可比期间(2012年01月01日至2012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
中国工商银行股份有限公司	3,727,905.38	8,037.05	3,094,753.76	9,430.22

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：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2013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

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。

6.4.12.2 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
600547	山东黄金	2013-04-03	筹划重大事项	32.13	2013-07-01	28.77	43,201	2,056,963.68	1,388,048.13	—
600598	北大荒	2013-05-27	筹划重大事项	8.35	2013-07-19	8.35	106,800	1,315,533.35	891,780.00	—

601918	国投新集	2013-05-16	筹划重大事项	7.55	2013-08-23	5.05	74,101	1,021,619.99	559,462.55	—
601989	中国重工	2013-05-17	筹划重大事项	4.52	—	—	358,060	2,744,009.65	1,618,431.20	—

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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额；没有因交易所市场债券正回购而作为抵押的债券。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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（2013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	3,727,905.38	—	—	—	—	—	3,727,905.38
结算备付金	12,169.88	—	—	—	—	—	12,169.88
存出保证金	3,484.52	—	—	—	—	—	3,484.52
交易性金融资产	—	—	—	—	—	289,691,219.29	289,691,219.29
应收利息	—	—	—	—	—	696.65	696.65
应收股利	—	—	—	—	—	2,585,442.16	2,585,442.16
资产总计	3,743,559.78	—	—	—	—	292,277,358.10	296,020,917.88
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	130,799.74	130,799.74
应付托管费	—	—	—	—	—	26,159.95	26,159.95
应付交易费用	—	—	—	—	—	43,166.13	43,166.13
其他负债	—	—	—	—	—	208,684.51	208,684.51
负债总计	—	—	—	—	—	408,810.33	408,810.33
利率敏感度缺口	3,743,559.78	—	—	—	—	291,868,547.77	295,612,107.55

上年度末（2012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	2,985,413.35	—	—	—	—	—	2,985,413.35
结算备付金	20.21	—	—	—	—	—	20.21
交易性金融资产	—	—	—	—	—	357,274,159.20	357,274,159.20
应收证券清算款	—	—	—	—	—	31,979.50	31,979.50
应收利息	—	—	—	—	—	656.48	656.48
资产总计	2,985,433.56	—	—	—	—	357,306,795.18	360,292,228.74
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	134.72	134.72
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	158,398.40	158,398.40
应付托管费	—	—	—	—	—	31,679.70	31,679.70
应付交易费用	—	—	—	—	—	436.65	436.65
其他负债	—	—	—	—	—	312,370.50	312,370.50
负债总计	—	—	—	—	—	503,019.97	503,019.97
利率敏感度缺口	2,985,433.56	—	—	—	—	356,803,775.21	359,789,208.77

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

假设	1. 影响生息资产的其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理。		
	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）	
分析		本期末（2013年06月30日）	上年度末（2012年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	0.00	0.00
	2. 基准点利率减少0.1%	0.00	0.00

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

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。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（2013年06月30日）	上年度末（2012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	289,691,219.29	98.00	357,274,159.20	99.30
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	289,691,219.29	98.00	357,274,159.20	99.30

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。下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。

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的风险变量保持不变。		
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 (2013年06月30日)	上年度末 (2012年12月31日)
	1. 业绩比较基准增加 1%	3,000,412.10	3,599,607.61
	2. 业绩比较基准减少 1%	-3,000,412.10	-3,599,607.61

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	289,691,219.29	97.86
	其中：股票	289,691,219.29	97.86
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	3,740,075.26	1.26
6	其他各项资产	2,589,623.33	0.87
7	合计	296,020,917.88	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合：

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.2 指数投资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	2,310,142.00	0.78
B	采矿业	52,664,957.57	17.82
C	制造业	74,867,012.30	25.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,533,081.39	4.24
E	建筑业	9,367,355.45	3.17
F	批发和零售业	7,970,166.50	2.70
G	交通运输、仓储和邮政业	12,144,649.00	4.11
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,631,332.80	2.24
J	金融业	93,888,609.40	31.76

K	房地产业	8,451,402.24	2.86
L	租赁和商务服务业	1,505,528.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	1,421,874.24	0.48
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	3,112,440.00	1.05
S	综合	2,822,668.40	0.95
	合计	289,691,219.29	98.00

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

7.3.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601857	中国石油	3,360,500	25,573,405.00	8.65
2	601288	农业银行	6,821,800	16,781,628.00	5.68
3	601988	中国银行	4,804,600	13,020,466.00	4.40
4	600028	中国石化	1,841,988	7,699,509.84	2.60
5	601628	中国人寿	438,800	6,007,172.00	2.03
6	601088	中国神华	318,300	5,392,002.00	1.82
7	600036	招商银行	460,800	5,345,280.00	1.81
8	600016	民生银行	570,000	4,884,900.00	1.65
9	601166	兴业银行	322,980	4,770,414.60	1.61
10	601328	交通银行	1,130,320	4,600,402.40	1.56
11	600519	贵州茅台	22,190	4,268,690.30	1.44
12	601818	光大银行	1,447,300	4,182,697.00	1.41
13	600000	浦发银行	501,940	4,156,063.20	1.41

14	601998	中信银行	1,034,460	3,837,846.60	1.30
15	601318	中国平安	99,600	3,462,096.00	1.17
16	600104	上汽集团	223,000	2,945,830.00	1.00
17	601169	北京银行	299,140	2,384,145.80	0.81
18	601939	建设银行	570,200	2,366,330.00	0.80
19	600015	华夏银行	262,100	2,364,142.00	0.80
20	600900	长江电力	317,900	2,199,868.00	0.74
21	600030	中信证券	206,100	2,087,793.00	0.71
22	601601	中国太保	130,200	2,074,086.00	0.70
23	601633	长城汽车	56,000	1,983,520.00	0.67
24	601668	中国建筑	597,100	1,952,517.00	0.66
25	601009	南京银行	221,300	1,865,559.00	0.63
26	600256	广汇能源	142,415	1,845,698.40	0.62
27	600887	伊利股份	55,600	1,739,168.00	0.59
28	600048	保利地产	165,604	1,641,135.64	0.56
29	601989	中国重工	358,060	1,618,431.20	0.55
30	601006	大秦铁路	270,800	1,608,552.00	0.54
31	600535	天士力	40,200	1,573,830.00	0.53
32	600804	鹏博士	144,700	1,532,373.00	0.52
33	601117	中国化学	156,500	1,489,880.00	0.50
34	600637	百视通	50,200	1,405,600.00	0.48
35	600518	康美药业	72,900	1,401,867.00	0.47
36	600547	山东黄金	43,201	1,388,048.13	0.47
37	600775	南京熊猫	193,800	1,385,670.00	0.47
38	600315	上海家化	29,950	1,347,450.50	0.46
39	600999	招商证券	127,950	1,330,680.00	0.45
40	600332	广州药业	38,200	1,308,732.00	0.44
41	600011	华能国际	240,500	1,284,270.00	0.43

42	600031	三一重工	169,800	1,275,198.00	0.43
43	601901	方正证券	226,300	1,251,439.00	0.42
44	601991	大唐发电	241,400	1,240,796.00	0.42
45	600703	三安光电	63,100	1,239,284.00	0.42
46	601800	中国交建	305,069	1,235,529.45	0.42
47	601231	环旭电子	78,500	1,226,955.00	0.42
48	600085	同仁堂	56,000	1,225,280.00	0.41
49	600585	海螺水泥	91,350	1,222,263.00	0.41
50	601336	新华保险	49,400	1,220,674.00	0.41
51	600893	航空动力	74,000	1,219,520.00	0.41
52	600276	恒瑞医药	44,670	1,177,501.20	0.40
53	601299	中国北车	307,290	1,155,410.40	0.39
54	601688	华泰证券	140,900	1,135,654.00	0.38
55	600597	光明乳业	84,000	1,133,160.00	0.38
56	600111	包钢稀土	54,200	1,131,154.00	0.38
57	600309	万华化学	69,941	1,120,454.82	0.38
58	601766	中国南车	307,564	1,107,230.40	0.37
59	600406	国电南瑞	73,970	1,104,372.10	0.37
60	600664	哈药股份	185,040	1,099,137.60	0.37
61	600050	中国联通	349,900	1,091,688.00	0.37
62	601877	正泰电器	54,978	1,090,763.52	0.37
63	600066	宇通客车	58,924	1,080,076.92	0.37
64	600583	海油工程	165,100	1,068,197.00	0.36
65	600018	上港集团	430,200	1,066,896.00	0.36
66	601238	广汽集团	143,300	1,054,688.00	0.36
67	600674	川投能源	102,667	1,044,123.39	0.35
68	600198	大唐电信	80,200	1,039,392.00	0.35
69	601158	重庆水务	201,700	1,038,755.00	0.35

70	600383	金地集团	151,400	1,038,604.00	0.35
71	600340	华夏幸福	31,750	1,033,145.00	0.35
72	601788	光大证券	99,500	1,014,900.00	0.34
73	601808	中海油服	71,100	1,001,799.00	0.34
74	600894	广日股份	124,300	996,886.00	0.34
75	600601	方正科技	430,300	989,690.00	0.33
76	600682	南京新百	115,000	984,400.00	0.33
77	601186	中国铁建	232,800	977,760.00	0.33
78	600624	复旦复华	129,400	976,970.00	0.33
79	601727	上海电气	291,900	974,946.00	0.33
80	600020	中原高速	450,400	963,856.00	0.33
81	600270	外运发展	143,800	963,460.00	0.33
82	601390	中国中铁	389,700	950,868.00	0.32
83	600600	青岛啤酒	24,700	938,106.00	0.32
84	600126	杭钢股份	313,000	935,870.00	0.32
85	600372	中航电子	44,600	934,370.00	0.32
86	600403	大有能源	109,000	928,680.00	0.31
87	600398	凯诺科技	299,000	926,900.00	0.31
88	600007	中国国贸	99,500	918,385.00	0.31
89	601607	上海医药	85,800	912,054.00	0.31
90	600795	国电电力	398,100	907,668.00	0.31
91	600089	特变电工	112,200	903,210.00	0.31
92	600598	北大荒	106,800	891,780.00	0.30
93	600663	陆家嘴	84,300	887,679.00	0.30
94	600626	申达股份	292,750	887,032.50	0.30
95	601339	百隆东方	117,200	884,860.00	0.30
96	601899	紫金矿业	370,000	880,600.00	0.30
97	600010	包钢股份	212,300	870,430.00	0.29

98	601099	太平洋	173,090	868,911.80	0.29
99	601618	中国中冶	539,400	868,434.00	0.29
100	601377	兴业证券	95,100	863,508.00	0.29
101	600850	华东电脑	38,090	862,738.50	0.29
102	601018	宁波港	425,900	860,318.00	0.29
103	601588	北辰实业	316,300	857,173.00	0.29
104	600062	华润双鹤	42,501	850,870.02	0.29
105	600987	航民股份	157,100	849,911.00	0.29
106	600998	九州通	73,100	847,229.00	0.29
107	600377	宁沪高速	157,100	846,769.00	0.29
108	600551	时代出版	81,200	846,104.00	0.29
109	601111	中国国航	198,500	841,640.00	0.28
110	600350	山东高速	290,300	833,161.00	0.28
111	601888	中国国旅	28,200	823,440.00	0.28
112	601718	际华集团	336,600	814,572.00	0.28
113	601898	中煤能源	165,700	810,273.00	0.27
114	600497	驰宏锌锗	82,673	806,061.75	0.27
115	600489	中金黄金	86,760	806,000.40	0.27
116	600770	综艺股份	136,500	805,350.00	0.27
117	600781	上海辅仁	61,800	797,838.00	0.27
118	600208	新湖中宝	257,440	795,489.60	0.27
119	601098	中南传媒	85,300	793,290.00	0.27
120	600832	东方明珠	143,200	789,032.00	0.27
121	600282	南钢股份	434,100	781,380.00	0.26
122	600834	申通地铁	143,000	777,920.00	0.26
123	601179	中国西电	252,900	773,874.00	0.26
124	600307	酒钢宏兴	276,100	773,080.00	0.26
125	601958	金钼股份	96,400	764,452.00	0.26

126	600819	耀皮玻璃	150,600	760,530.00	0.26
127	600143	金发科技	156,006	753,508.98	0.25
128	600690	青岛海尔	68,700	749,517.00	0.25
129	601669	中国水电	260,000	748,800.00	0.25
130	601933	永辉超市	64,000	746,880.00	0.25
131	600757	长江传媒	127,100	742,264.00	0.25
132	600221	海南航空	364,300	735,886.00	0.25
133	600741	华域汽车	94,300	735,540.00	0.25
134	601801	皖新传媒	70,200	730,782.00	0.25
135	600798	宁波海运	236,600	723,996.00	0.24
136	601139	深圳燃气	81,100	720,979.00	0.24
137	600369	西南证券	93,800	719,446.00	0.24
138	601699	潞安环能	60,100	718,796.00	0.24
139	601118	海南橡胶	173,300	717,462.00	0.24
140	600006	东风汽车	258,600	716,322.00	0.24
141	600019	宝钢股份	181,400	712,902.00	0.24
142	600665	天地源	220,000	710,600.00	0.24
143	600171	上海贝岭	161,500	704,140.00	0.24
144	600108	亚盛集团	107,500	700,900.00	0.24
145	600236	桂冠电力	216,000	697,680.00	0.24
146	600118	中国卫星	49,100	696,238.00	0.24
147	600267	海正药业	54,600	694,512.00	0.23
148	600765	中航重机	51,400	690,816.00	0.23
149	601558	华锐风电	181,302	690,760.62	0.23
150	600188	兖州煤业	73,401	689,969.40	0.23
151	601369	陕鼓动力	101,750	686,812.50	0.23
152	601106	中国一重	338,400	683,568.00	0.23
153	600861	北京城乡	115,100	682,543.00	0.23

154	600415	小商品城	134,800	682,088.00	0.23
155	600578	京能热电	98,300	681,219.00	0.23
156	600863	内蒙华电	120,200	679,130.00	0.23
157	601600	中国铝业	215,000	677,250.00	0.23
158	600423	柳化股份	166,600	676,396.00	0.23
159	601777	力帆股份	128,100	675,087.00	0.23
160	600569	安阳钢铁	419,300	670,880.00	0.23
161	600362	江西铜业	42,401	667,391.74	0.23
162	600809	山西汾酒	27,202	666,449.00	0.23
163	600100	同方股份	97,000	665,420.00	0.23
164	601555	东吴证券	96,500	661,025.00	0.22
165	600271	航天信息	49,300	651,746.00	0.22
166	600655	豫园商城	99,500	647,745.00	0.22
167	600150	中国船舶	40,054	647,673.18	0.22
168	600575	芜湖港	269,900	645,061.00	0.22
169	600115	东方航空	251,800	644,608.00	0.22
170	601992	金隅股份	128,200	641,000.00	0.22
171	600588	用友软件	70,980	634,561.20	0.21
172	600054	黄山旅游	61,801	632,842.24	0.21
173	600029	南方航空	224,300	632,526.00	0.21
174	600109	国金证券	54,900	631,350.00	0.21
175	600348	阳泉煤业	68,800	621,952.00	0.21
176	600697	欧亚集团	33,600	617,904.00	0.21
177	600027	华电国际	196,100	617,715.00	0.21
178	600021	上海电力	149,400	615,528.00	0.21
179	600166	福田汽车	120,200	613,020.00	0.21
180	601678	滨化股份	84,350	600,572.00	0.20
181	600820	隧道股份	79,300	590,785.00	0.20

182	600180	瑞茂通	86,100	574,287.00	0.19
183	601168	西部矿业	105,600	571,296.00	0.19
184	600875	东方电气	55,300	570,696.00	0.19
185	600724	宁波富达	133,300	569,191.00	0.19
186	600844	丹化科技	76,600	564,542.00	0.19
187	600827	友谊股份	82,000	563,340.00	0.19
188	600103	青山纸业	257,500	561,350.00	0.19
189	601918	国投新集	74,101	559,462.55	0.19
190	600068	葛洲坝	140,300	552,782.00	0.19
191	600549	厦门钨业	20,500	547,350.00	0.19
192	601001	大同煤业	94,000	538,620.00	0.18
193	600121	郑州煤电	97,500	531,375.00	0.18
194	600546	山煤国际	42,800	506,752.00	0.17
195	601666	平煤股份	95,530	496,756.00	0.17
196	600395	盘江股份	50,750	464,362.50	0.16
197	601717	郑煤机	73,900	461,875.00	0.16
198	600160	巨化股份	78,580	458,121.40	0.15
199	600300	维维股份	95,900	407,575.00	0.14
200	600157	永泰能源	60,400	353,340.00	0.12

7.3.2 期末积极投资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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	600423	柳化股份	1,053,707.00	0.29
2	601339	百隆东方	1,036,764.50	0.29

3	600894	广日股份	1,012,503.84	0.28
4	600834	申通地铁	1,005,364.01	0.28
5	600624	复旦复华	962,577.02	0.27
6	600863	内蒙华电	943,949.80	0.26
7	600089	特变电工	923,839.00	0.26
8	600850	华东电脑	923,514.50	0.26
9	600180	瑞茂通	855,959.00	0.24
10	601139	深圳燃气	848,134.00	0.24
11	600765	中航重机	841,951.70	0.23
12	600578	京能热电	836,633.32	0.23
13	600118	中国卫星	826,855.95	0.23
14	600108	亚盛集团	815,602.66	0.23
15	600198	大唐电信	807,810.28	0.22
16	600121	郑州煤电	788,649.69	0.22
17	600820	隧道股份	768,465.80	0.21
18	600157	永泰能源	594,324.60	0.17
19	601328	交通银行	443,145.00	0.12
20	600844	丹化科技	407,388.00	0.11

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	600780	通宝能源	1,820,240.92	0.51
2	600277	亿利能源	1,412,094.41	0.39
3	600803	威远生化	1,254,883.84	0.35
4	600016	民生银行	1,240,643.92	0.34
5	601005	重庆钢铁	1,073,685.57	0.30

6	600648	外高桥	957,951.78	0.27
7	600694	大商股份	869,833.00	0.24
8	600510	黑牡丹	842,852.27	0.23
9	600498	烽火通信	813,580.66	0.23
10	600000	浦发银行	752,566.63	0.21
11	600987	航民股份	733,285.03	0.20
12	600792	云煤能源	723,163.89	0.20
13	600058	五矿发展	707,826.98	0.20
14	600376	首开股份	701,884.78	0.20
15	600629	棱光实业	640,798.12	0.18
16	600873	梅花集团	634,701.65	0.18
17	601566	九牧王	630,079.07	0.18
18	600036	招商银行	606,001.06	0.17
19	600061	中纺投资	604,952.26	0.17
20	600859	王府井	602,789.93	0.17

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	23,557,654.17
卖出股票收入（成交）总额	23,573,757.86

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（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

注：本基金本报告期末未持有债券资产。

7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券资产。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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	3,484.52
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	2,585,442.16
4	应收利息	696.65
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—

7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,589,623.33

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.10.6 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	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
957	149,570.02	133,862,542.00	93.52	9,275,971.00	6.48

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行股份有限公司—富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	中国工商银行股份有限公司—富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	128,121,447	89.51
2	国元证券股份有限公司	3,422,321	2.39
3	上海安信农业保险股份有限公司	1,711,160	1.20
4	孙明建	500,000	0.35
5	王月华	400,000	0.28
6	上海市民帮困互助基金会	342,232	0.24
6	田朝晖	247,500	0.17
8	红塔证券股份有限公司	226,556	0.16
9	李桂平	172,759	0.12
10	王晓健	172,100	0.12

8.3 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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2、本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年01月30日)基金份额总额	320,363,407.00
报告期期初基金份额总额	152,638,513.00
本报告期基金总申购份额	4,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	14,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—

本报告期末基金份额总额	143,138,513.00
-------------	----------------

§ 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。

本报告期本基金管理人于 2013 年 6 月 7 日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上公告，窦玉明先生不再担任本公司总经理，由陈敏女士代行公司总经理职责。

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。

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

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

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 (%)	
银河证券	2	46,935,484.67	100.00	—	—	—	—	—	—	42,729.48	100.00	—
中信证券	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提请广大投资者持有效身份证件办理相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2013年01月04日
2	富国基金管理有限公司关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金调整成份股的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2013年02月21日
3	富国基金管理有限公司关于撤销深圳分公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2013年04月18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、公司网站	2013年06月07日
5	富国基金管理有限公司关于新增部分基金后端收费模式及后端收费模式基金转换费率计算方式变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2013年06月15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上证综指交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、上证综指交易型开放式指数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、上证综指交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	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： http://www.fullgoal.com.cn