

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:2012年08月25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责任。本年度报告经本公司内部审核委员会审核，并由董事长签发。

基金托管人中工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年8月23日核对了本基金报告中的财务数据、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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至2012年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称:富国沪深300增强

基金主代码:100038

交易代码:富国沪深300增强

后缀代码:—

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2009年12月16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

报告期基金份额总额:7,156,466,249.23份

基金合同延续期间:不定期

2.2 基金产品说明

本基金为增强型股票指数基金，在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险管理，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金的长期增值。

投资策略:本基金以“指数化投资为主，主动性投资为辅”，在复制目标指数的基础上，适度地调整个股，以期获得超越指数的适度超越目标指数。

业绩比较基准:95%×沪深300指数收益率+1%×(指定期收益率-沪深300指数收益率)

本基金是一只股票型增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

风险收益特征:本基金的预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市

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

姓名 朱木森 赵会军

联系人电话 021-20361818 010-66105799

电子邮件 public@fullgoal.com.cn custody@icbc.com.cn

客户服务电话 95105686, 4008880688 95588

传真 021-20361616 010-66105798

2.4 信息披露方式

管理人互联网网址:www.fullgoal.com.cn

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

基金半年度报告备置地点 中心二期16-17层

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

信息披露负责人 姚晓峰

联系人电话 021-20361818 010-66105799

电子邮件 public@fullgoal.com.cn custody@icbc.com.cn

客户服务电话 95105686, 4008880688 95588

传真 021-20361616 010-66105798

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(2012年01月01日至2012年06月30日)

本期已实现收益 16,916,439.09

本期利润 318,539,695.89

加权平均基金份额本期利润 0.0514

本期基金份额净值增长率 8.68%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2012年06月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.1494

期末基金资产净值 6,087,157,243.78

期末基金份额净值 0.851

注:上述基金业绩指标不包括所有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),计算费用后实际收益水平要低所列数值。

本期已实现收益指基金本期收入,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,本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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(%) 业绩比较基准收益率(%)

份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去一个月 -5.13% 1.06% -0.04% 0.91% 0.02%

过去三个月 2.28% 1.09% 0.65% 1.07% 1.63% 0.02%

过去六个月 8.68% 1.27% 5.52% 1.26% 3.16% 0.01%

过去一年 -13.78% 1.30% -16.94% 1.28% 3.16% 0.02%

自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

率: -14.90% 1.37% -27.06% 1.36% 12.16% 0.01%

注:注:上述表格中基金的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告的日期。

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其基金经理的简介

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.2 基金管理人及其基金经理的从业经验

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.3 基金管理人及其基金经理的从业经历

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.4 基金管理人及其基金经理的从业资格

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.5 基金管理人及其基金经理的从业年限

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.6 基金管理人及其基金经理的从业经验

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.7 基金管理人及其基金经理的从业经历

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.8 基金管理人及其基金经理的从业资格

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.9 基金管理人及其基金经理的从业年限

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.10 基金管理人及其基金经理的从业经验

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.11 基金管理人及其基金经理的从业经历

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.12 基金管理人及其基金经理的从业资格

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.13 基金管理人及其基金经理的从业年限

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.14 基金管理人及其基金经理的从业经验

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.15 基金管理人及其基金经理的从业经历

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.16 基金管理人及其基金经理的从业资格

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.17 基金管理人及其基金经理的从业年限

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.18 基金管理人及其基金经理的从业经验

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.19 基金管理人及其基金经理的从业经历

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.20 基金管理人及其基金经理的从业资格

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.21 基金管理人及其基金经理的从业年限

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.22 基金管理人及其基金经理的从业经验

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.23 基金管理人及其基金经理的从业经历

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设立的基金管理公司之一,第一家外资合资的基金管理公司。

4.1.24 基金管理人及其基金经理的从业资格

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基金管理公司之一,公司于2001年3月从北京迁