

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8月25日

§ 1 重要提示及目录

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认。

基金管理人中国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。

本年度报告摘要概括自年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012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	富国上证综指ETF联接基金
基金主代码	100053
交易代码	前端交易代码:100053 后端交易代码:-
基金运作方式	契约型开放式
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	466,138,424.17份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证综指交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510210
交易运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同成立日	2011年01月30日
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03月25日
基金管理人名称	富国基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于目标ETF，即上证综指交易型开放式指数证券投资基金，紧跟跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
风险收益特征	本基金为ETF联接基金，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。
2.2.1 目标基金产品说明	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资目标	上证综指交易型开放式指数证券投资基金将采用优化抽样复制法的指数。
投资策略	本基金将通过量化分析指数跟踪误差，从而实现对标的指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	上证综指交易型开放式指数证券投资基金股票型基金，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。同时上证综指交易型开放式指数证券投资基金为指数型基金，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 基金管理人员和基金托管人	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 林志松 赵威军 信息披露负责人 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 95105686,4008806868 95588 传真 021-20361616 010-66105798

2.4 信息披露方式

披露基金半年度报告正文的管理人互联网网址	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号上海国金中心二期16-17楼
基金半年度报告备置地点	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
§ 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 本期期间数据和指标	报告期(2012年01月01日至2012年06月30日)
本期已实现收益	-2,315,602.22
本期利润	11,582,018.35
加权平均基金份额本期利润	0.0246
本期基金份额净值增长率	3.12%

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	-0.2061
期末基金份额净值	370,057,192.57
期末基金资产净值	0.794

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，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	业绩比较基准收益率标准差②	③-④
过去一个月	-4.22%	0.94%	-5.88%
过去三个月	0.63%	0.91%	-1.55%
过去六个月	3.12%	1.08%	-1.17%
过去一年	-16.42%	1.13%	-18.47%
自基金合同生效日至至今	-20.60%	1.04%	-18.18%
至今			-1.07%

注：基金合同于2011年1月30日生效。

根据上证综指成份股的有关约定，本基金即上证综指成份股-95%+上证综指成份股-5%*上证综指成份股-5%*现金红利。

根据上证综指成份股-5%*现金红利的有关规定，本基金即上证综指成份股-5%*上证综指成份股-5%*现金红利。

本基金即上证综指成份股-5%*现金红利的有关规定，本基金即上证综指成份股-5%*上证综指成份股-5%*现金红利。

本基金即上证综指成份股-5%*现金红利的有关规定，本基金即上证综指成份股-5%*上证综指成份股-5%*现金红利。