富国天博创新主题股票型证券投资基金

【2013】第二季度报告

基金管理人:富国基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年07月18日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至2013年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	富国天博创新股票
基金主代码	519035
交易代码	前端交易代码:519035 后端交易代码:519036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年04月27日
报告期末基金份额总额(单位:份)	7,240,244,323.07
投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题类上市公司,在充分注重投资组合收益性、流动性与安全性的基础上,力争实现资本的长期稳定增值。
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,将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	中信标普300指数×80%+中信标普国债指数×15%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资基金品种。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年04月01日-2013年06月30日)
1.本期已实现收益	-85,755,974.86
2.本期利润	-98,773,383.30
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0134
4.期末基金资产净值	5,348,748,254.69
5.期末基金份额净值	0.7388

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。

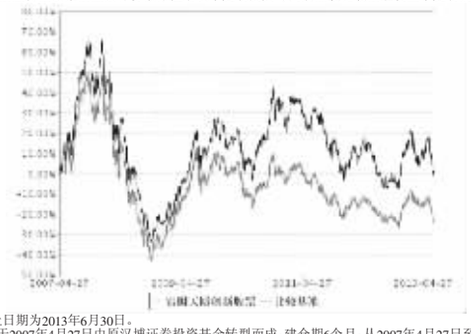
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.12%	1.57%	-8.91%	1.14%	6.79%	0.43%

注:过去三个月指2013年4月1日-2013年6月30日

3.2.2 自基金转型以来基金累计份额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。

本基金于2007年4月27日由原汉博证券投资基金转型而成,建仓期6个月,从2007年4月27日至2007年10月26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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
毕天宇	本基金基金经理兼任权益投资副总监	2005-11-26	-	14年	硕士,曾任中国燕兴桂林公司汽车经营部经理助理;中国北方工业上海公司经理助理;兴业证券股份有限公司研究员;2002年3月任富国基金管理有限公司行业研究员,2005年11月至今任富国天博基金经理,兼任权益投资副总监。具有基金从业资格,中国国籍。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国天博创新主题股票型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以尽可能减少和分散投资风险,确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 公平交易专项说明

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(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,因组合流动性管理或投资策略调整需要,出现5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 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

二季度沪深300指数下跌11.8%。同期净值下跌2.1%。

市场在6月下旬出现急速下滑,幅度之大近年罕见。经济差强人意,政策不清晰,市场信心不足是主要原因。针对宏观经济新的变化,二季度我们对组合进行了适度调整,增持了LED、通讯、传媒等行业配置。

我们认为,市场恐慌早已过度反映经济悲观一面,中国经济增长的潜力和空间还在。转型和增长并不对立,保持一定的增长速度更有利于经济转型。在注意防范部分行业去产能和去库存带来的风险同时,也存在许多空间大和增速快的行业投资机会,我们将积极寻找并力争为投资者争取较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金净值增长率为-2.12%,业绩比较基准收益率为-8.91%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,024,420,712.81	93.70
	其中:股票	5,024,420,712.81	93.70
2	固定收益投资	308,616,000.00	5.76
	其中:债券	308,616,000.00	5.76
	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	20,543,653.25	0.38
6	其他资产	8,665,094.05	0.16
7	合计	5,362,245,460.11	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	90,400.00	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,193,210,213.93	59.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,392,906.76	1.05
E	建筑业	91,877,484.80	1.72
F	批发和零售业	43,710,201.13	0.82
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	267,812,091.57	5.01
J	金融业	490,395,992.68	9.17
K	房地产业	864,320,816.13	16.16
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	10,983,920.93	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	1,399,000.00	0.03
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	4,227,684.88	0.08
S	综合	-	-
	合计	5,024,420,712.81	93.94

5.3 报告期末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

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	600519	贵州茅台	2,700,000	519,399,000.00	9.71
2	000581	威孚高科	14,950,000	499,180,500.00	9.33
3	601166	兴业银行	29,323,691	433,110,916.07	8.10
4	000718	苏宁环球	61,807,000	363,425,160.00	6.79
5	002271	东方雨虹	14,787,157	273,562,404.50	5.11
6	600703	三安光电	13,680,587	268,686,728.68	5.02
7	000024	招商地产	10,011,118	243,069,945.04	4.54
8	600031	三一重工	30,000,000	225,300,000.00	4.21
9	002028	思源电气	11,509,216	181,039,967.68	3.38
10	002422	科伦药业	2,805,109	149,540,360.79	2.80

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	59,724,000.00	1.12
2	央行票据	29,967,000.00	0.56
3	金融债券	218,925,000.00	4.09
	其中:政策性金融债	218,925,000.00	4.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	308,616,000.00	5.77

5.5 报告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

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	130201	13国开01	900,000	89,505,000.00	1.67
2	120238	12国开38	700,000	69,762,000.00	1.30
3	130218	13国开18	600,000	59,658,000.00	1.12
4	130002	13附息国债02	400,000	39,796,000.00	0.74
5	1001060	10央行票据60	300,000	29,967,000.00	0.56

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1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。

5.8.2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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1中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。

本期,本基金持有的贵州茅台于2013年2月23日公告其于2013年2月22日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》,因其控股子公司贵州茅台酒销售有限公司限定销售茅台酒最低价格,违反《中华人民共和国反垄断法》而被行政处罚。

本基金持有的科伦药业于2013年5月21日公告其于2013年5月20日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《调查通知书》(稽查总队调查通字13139号),因其公司涉嫌信息披露违法违规,故中国证监会对其立案调查。

基金管理人将密切跟踪相关进展,遵循价值投资的理念进行投资决策。

5.9.2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。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.9.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	659,872.02
2	应收证券清算款	1,434,081.93
3	应收股利	952,523.15
4	应收利息	5,276,641.28
5	应收申购款	341,975.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,665,094.05

5.9.4报告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。

5.9.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.9.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	7,721,615,662.56
报告期期间基金总申购份额	14,717,372.24
减:报告期期间基金总赎回份额	496,088,711.73
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	7,240,244,323.07

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立汉博证券投资基金的文件

2、汉博证券投资基金基金合同

3、汉博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、中国证监会《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》

6、富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同

7、富国天博创新主题股票型证券投资基金托管协议

8、汉博证券投资基金财务报表及报表附注

9、富国天博创新主题股票型证券投资基金财务报表及报表附注

10、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

7.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

7.3 查阅方式

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

富国基金管理有限公司
2013年07月18日

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

【2013】第二季度报告

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
报告送出日期:2013年07月18日

§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。

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7月16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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	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
报告期末基金份额总额(单位:份)	143,138,513.00
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,从而实现对标的指数的紧密跟踪。
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年04月01日-2013年06月30日)
1.本期已实现收益	1,685,981.13
2.本期利润	-35,279,449.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2419
4.期末基金资产净值	295,612,107.55
5.期末基金份额净值	2.065

注:1.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。

2.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。

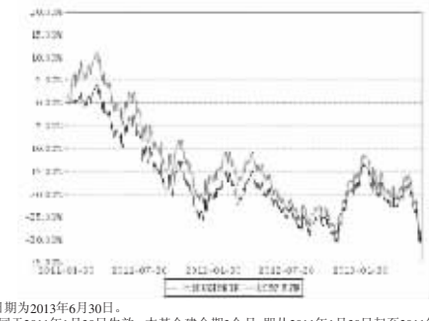
3.2 上证综指交易型开放式指数证券投资基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-10.72%	1.21%	-11.51%	1.20%	0.79%	0.01%

注:过去三个月指2013年4月1日-2013年6月30日

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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。

本基金合同于2011年1月30日生效。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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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,确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 公平交易专项说明

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(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,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 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

回顾2013年二季度,国内经济依然呈现弱复苏态势,投资者对于经济增长的前景较为悲观,认为经济增长点抱有一定的期望。二季度市场呈现先扬后抑走势,上证综指下跌11.5%。

在投资管理上,我们坚持采取量化策略进行指数跟踪,报告期内,本基金的年化跟踪误差为1.58%。

展望2013年三季度,国内经济将继续呈现出弱复苏的态势,随着IPO重新开放,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,估计市场在三季度将呈现震荡向上走势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为-10.72%,同期业绩比较基准收益率为-11.51%。

§5 上证综指交易型开放式指数证券投资基金投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	其他资产	2,589,623.33	0.87
7	合计	296,020,917.88	100.00

5.2 报告期末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。

5.3 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.4.1报告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前十名股票投资明细

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

5.4.2报告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前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.8 报告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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3报告期末其他资产构成

序号	名称	金额(元)
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

5.10.4报告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。

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2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。

5.10.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	148,638,513.00
报告期期间基金总申购份额	2,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	7,500,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	143,138,513.00

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

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

7.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

7.3 查阅方式

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

富国基金管理有限公司
2013年07月18日

富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2013】第二季度报告

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
报告送出日期:2013年07月18日

§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。

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7月16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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	富国上证综指ETF联接
基金主代码	100053
交易代码	前端交易代码:100053 后端交易代码:000164
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
报告期末基金份额总额(单位:份)	387,671,180.99
投资目标	通过主要投资于目标ETF,即富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为目标ETF(富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金)的联接基金,主要通过投资于目标ETF以达到投资目标。当本基金申购赎回和买卖目标ETF,或基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,本管理人会在10个交易日内对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	95%×上证综合指数收益率+5%×银行活期存款税后利率
风险收益特征	本基金为ETF联接基金,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。
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

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

2.1.2 目标基金产品概况

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	上证综指交易型开放式指数证券投资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,从而实现对标的指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	上证综合指数
风险收益特征	上证综指交易型开放式指数证券投资基金属股票型基金,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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年04月01日-2013年06月30日)
1.本期已实现收益	-3,546,361.71
2.本期利润	-31,819,355.44
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0796
4.期末基金资产净值	278,081,402.84
5.期末基金份额净值	0.717

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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 | 净值增长率① | 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 |