

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

2014 第一季度报告

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
报告期截止日期:	2014年07月31日

富国基金管理有限公司的董事会及董事承诺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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2014年7月16日发布了本报告中的财务报表，请投资者仔细阅读报告内容，谨慎做出投资决策，同时基金管理人不承担由此产生的任何法律责任。

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，基金的投资业绩并不表示对未来表现。投资者在作出投资决策前请仔细阅读基金合同的招募说明书。

本报告材料并不构成对投资者投资建议。

本报告日期为2014年4月1日至2014年6月30日止。

5.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事承诺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。

5.2 基金产品概况

基金名称	上证综指ETF
基金代码	510101
交易所代码	510101
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2011年03月30日
报告期末基金份额总额(单位:份)	118,138,513.00

投资目标: 紧密跟踪标的指数(上证综指),追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

投资策略: 本基金采用完全复制法跟踪标的指数,最大限度降低跟踪误差,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

风险收益特征: 本基金属于股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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

2.0 报告期内未发生重大行政处罚事项。

2.1 基金管理人报告期内未发生违法违规行为。

2.2 报告期内未发生重大行政处罚事项。

5.3 主要财务指标和净值表现

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	权益类投资	2,143,718,000	0.12
B	固定收益类	44,695,063.79	0.37
C	债券类	72,101,375.27	0.61
D	货币类	11,982,274.58	0.10
E	其他类	9,609,204.44	0.08
F	银行存款	6,706,961.22	0.06
G	交易类	4,504,925.00	0.04
H	待摊费用	--	--
I	应收股利	5,035,881.42	0.04
J	应付利息	81,201,762.74	0.68
K	其他资产	7,399,651.81	0.06
L	负债类	1,361,932.00	0.01
M	所有者权益	118,138,513.00	1.00
N	其他	2,032,209.75	0.02
P	其他	--	--
Q	其他	--	--
R	其他	--	--
S	其他	3,554,229.00	0.03
T	其他	95,777,881.80	0.81

5.4 投资组合报告

4.1 报告期末股票资产公允价值占基金资产净值的比例

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	601887	中国神华	2,887,100	21,769,734.00	0.18
2	600288	包装集团	5,716,500	14,405,580.00	0.12
3	601988	中国银行	4,058,800	18,349,940.00	0.15
4	600028	中国石化	1,645,988	8,674,356.76	0.07
5	601046	中国平安	367,800	5,005,758.00	0.04
6	601166	兴业银行	411,170	4,124,035.10	0.03
7	600000	浦发银行	446,040	4,056,622.00	0.03
8	600036	招商银行	393,391	4,028,323.84	0.03
9	601088	中国稀土	267,489	3,807,996.00	0.03
10	601328	交通银行	999,720	3,840,113.60	0.03

富国天博创新主题股票型证券投资基金

2014 第一季度报告

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
报告期截止日期:	2014年07月31日

富国基金管理有限公司的董事会及董事承诺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约定，于2014年7月16日发布了本报告中的财务报表，请投资者仔细阅读报告内容，谨慎做出投资决策，同时基金管理人不承担由此产生的任何法律责任。

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，基金的投资业绩并不表示对未来表现。投资者在作出投资决策前请仔细阅读基金合同的招募说明书。

本报告材料并不构成对投资者投资建议。

本报告日期为2014年4月1日至2014年6月30日止。

5.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事承诺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。

5.2 基金产品概况

基金名称	富国天博创新主题股票
基金代码	510035
交易所代码	510035
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)	6,238,918,421.73

投资目标: 本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题上市公司,追求长期资本增值,并谋求超越业绩比较基准的长期稳定回报。

投资策略: 本基金采用“自上而下”与“自下而上”相结合的双主动投资策略,动态优化资产配置,积极把握市场机会,追求长期资本增值。

风险收益特征: 本基金属于股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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

5.3 主要财务指标和净值表现

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益类投资	498,440,000.00	7.99
2	固定收益类	456,039,760.00	7.34
3	债券类	446,969,052.00	7.28
4	货币类	36,343,678.00	0.58
5	其他类	32,887,270.22	0.53
6	银行存款	170,308,256.59	2.73
7	交易类	276,479,829.21	4.44
8	待摊费用	--	--
9	应收股利	533,149,833.89	8.56
10	应付利息	3,451,238.00	0.06
11	其他资产	6,402,811.53	0.10
12	负债类	--	--
13	所有者权益	6,238,918,421.73	100.00
14	其他	--	--

4.1 报告期末股票资产公允价值占基金资产净值的比例

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	000881	潍柴高科	18,000,000	485,460,000.00	9.62
2	600519	贵州茅台	3,212,000	456,039,760.00	9.04
3	002271	东方雨虹	17,986,320	446,969,052.00	8.86
4	600703	三七互娱	16,601,960	388,088,832.82	7.63
5	000024	招商地产	30,014,614	312,752,278.80	6.20
6	600565	浙商银行	8,000,000	260,400,000.00	5.27
7	300133	利信国际	2,242,280	234,589,136.85	4.68
8	000712	广生股份	12,029,724	179,673,773.32	3.54
9	600570	恒生电子	6,000,000	176,400,000.00	3.50
10	300387	东方医疗	2,000,000	169,200,000.00	3.33

富国天博创新主题股票型证券投资基金招募说明书全文

基金合同全文

基金托管协议

基金销售服务协议

5.4 投资组合报告

4.1 报告期末股票资产公允价值占基金资产净值的比例

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	099024	09国债24	790,000	69,944,000.00	1.39
2	113005	平安转债	500,000	53,410,000.00	1.06
3	140204	14国债74	500,000	50,225,000.00	1.00
4	130418	13国债18	500,000	50,015,000.00	0.99
5	130418	13国债18	500,000	49,880,000.00	0.99

4.2 报告期末本基金前十名重仓股的行业分布

行业	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
医药生物	332,935,353.90	6.66
国防军工	199,128,000.00	3.77
计算机	199,128,000.00	3.77
公用事业	--	--
5 公共事业类	--	--
6 中期票据	--	--
7 可转债	72,863,353.90	1.44
8 其他	--	--
9 合计	691,488,108.46	13.72

4.3 报告期末本基金前十名重仓股的公司名称

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	099024	09国债24	790,000	69,944,000.00	1.39
2	113005	平安转债	500,000	53,410,000.00	1.06
3	140204	14国债74	500,000	50,225,000.00	1.00
4	130418	13国债18	500,000	50,015,000.00	0.99
5	130418	13国债18	500,000	49,880,000.00	0.99

注:截止2014年11月30日,本基金在报告期内,即2014年11月30日至2015年11月30日,建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4.2 报告期末本基金前十名重仓股的行业分布

行业	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
医药生物	412,558,100.00	8.14
国防军工	202,000,000.00	4.05
计算机	199,128,000.00	4.00
公用事业	--	--
5 公共事业类	--	--
6 中期票据	--	--
7 可转债	72,863,353.90	1.44
8 其他	--	--
9 合计	812,558,100.00	16.25

4.3 报告期末本基金前十名重仓股的公司名称

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	099024	09国债24	790,000	69,944,000.00	1.39
2	113005	平安转债	500,000	53,410,000.00	1.06
3	140204	14国债74	500,000	50,225,000.00	1.00
4	130418	13国债18	500,000	50,015,000.00	0.99
5	130418	13国债18	500,000	49,880,000.00	0.99

4.4 报告期末本基金前十名重仓股的行业分布

行业	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
医药生物	412,558,100.00	8.14
国防军工	202,000,000.00	4.05
计算机	199,128,000.00	4.00
公用事业	--	--
5 公共事业类	--	--
6 中期票据	--	--
7 可转债	72,863,353.90	1.44
8 其他	--	--
9 合计	812,558,100.00	16.25

4.5 报告期末本基金前十名重仓股的公司名称

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	099024	09国债24	790,000	69,944,000.00	1.39
2	113005	平安转债	500,000	53,410,000.00	1.06
3	140204	14国债74	500,000	50,225,000.00	1.00
4	130418	13国债18	500,000	50,015,000.00	0.99
5	130418	13国债18	500,000	49,880,000.00	0.99

注:截止2014年11月30日,本基金在报告期内,即2014年11月30日至2015年11月30日,建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4.2 报告期末本基金前十名重仓股的行业分布

行业	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
医药生物	412,558,100.00	8.14
国防军工	202,000,000.00	4.05
计算机	199,128,000.00	4.00
公用事业	--	--
5 公共事业类	--	--
6 中期票据	--	--
7 可转债	72,863,353.90	1.44
8 其他	--	--
9 合计	812,558,100.00	16.25

4.3 报告期末本基金前十名重仓股的公司名称

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	099024	09国债24	790,000	69,944,000.00	1.39
2	113005	平安转债	500,000	53,410,000.00	1.06
3	140204	14国债74	500,000	50,225,000.00	1.00
4	130418	13国债18	500,000	50,015,000.00	0.99
5	130418	13国债18	500,000	49,880,000.00	0.99

4.6 报告期末本基金前十名重仓股的公司名称

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	099024	09国债24	790,000	69,944,000.00	1.39
2	113005	平安转债	500,000	53,410,000.00	1.06
3	140204	14国债74	500,000	50,225,000.00	1.00
4	130418	13国债18	500,000	50,015,000.00	0.99
5	130418	13国债18	500,000	49,880,000.00	0.99

注:截止2014年11月30日,本基金在报告期内,即2014年11月30日至2015年11月30日,建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4.2 报告期末本基金前十名重仓股的行业分布

行业	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
医药生物	412,558,100.00	8.14
国防军工	202,000,000.00	4.05
计算机	199,128,000.00	4.00
公用事业	--	--
5 公共事业类	--	--
6 中期票据	--	--
7 可转债	72,863,353.90	1.44
8 其他	--	--
9 合计	812,558,100.00	16.25

4.3 报告期末本基金前十名重仓股的公司名称

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	099024	09国债24	790,000	69,944,000.00	1.39
2	113005	平安转债	500,000	53,410,000.00	1.06
3	140204	14国债74	500,000	50,225,000.00	1.00
4	130418	13国债18	500,000	50,015,000.00	0.99
5	130418	13国债18	500,000	49,880,000.00	0.99

注:截止2014年11月30日,本基金在报告期内,即2014年11月30日至2015年11月30日,建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4.2 报告期末本基金前十名重仓股的行业分布

行业	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
医药生物	412,558,100.00	8.14
国防军工	202,000,000.00	4.05
计算机	199,128,000.00	4.00
公用事业	--	--
5 公共事业类	--	--
6 中期票据	--	--
7 可转债	72,863,353.90	1.44
8 其他	--	--
9 合计	812,558,100.00	16.25

4.3 报告期末本基金前十名重仓股的公司名称

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	099024	09国债24	790,000	69,944,000.00	1.39
2	113005	平安转债	500,000	53,410,000.00	1.06
3	140204	14国债74	500,000	50,225,000.00	1.00
4	130418	13国债18	500,000	50,015,000.00	0.99
5	130418	13国债18			