

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

[2012] 第四季度报告

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1月19日

重要提示

在投资管理上,我们坚持采取量化策略进行指数跟踪,并获得了较好的跟踪效果。报告期内,本基金的超额收益为0.35%,年化跟踪误差为0.82%。

展望2013年一季度,在海外市场基本稳定和国内经济企稳回升的大背景下,投资者情绪继续好转可能性较大,目前市场点位下,仍然有许多股票投资价值被低估。综合来看,一季度市场可能延续2012年四季度的反弹。

4.2 报告期内基金的基本情况

报告期末基金份额总额(单位:份) 152,638,513.00

报告期利润 32,469,355.15

加权平均基金份额本期利润 0.1825

本期基金份额净值 359,789,208.77

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	357,274,159.20	99.16
其中:股票		357,274,159.20	99.16
2	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	-
货币支持证券	-	-	-
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	2,985,433.56	0.83
6	其他资产	32,635.98	0.01
7	合计	360,292,228.74	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金未持有按行业分类的股票投资组合。

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金未持有按行业分类的股票投资组合。

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前十名股票投资明细

注:本基金未持有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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细。

5.7 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资产支持证券投资明细

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细。

5.11 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

注:本基金未持有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。

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合。

5.13 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贵金属投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合。

5.14 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资产支持证券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合。

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合。

5.17 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组合

注:本基金未持有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组合。

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合。

5.19 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贵金属投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合。

5.20 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资产支持证券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合。

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合。

5.23 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组合

注:本基金未持有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组合。

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合。

5.25 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贵金属投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合。

5.26 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资产支持证券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合。

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合。

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合。

5.29 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组合

注:本基金未持有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组合。

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合。

5.31 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贵金属投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合。

5.32 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资产支持证券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合。

5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合。

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合。

5.35 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组合

注:本基金未持有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组合。

5.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合。

5.37 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贵金属投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合。

5.38 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资产支持证券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合。

5.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合。

5.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合。

5.41 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组合

注:本基金未持有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组合。

5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合。

5.43 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贵金属投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合。

5.44 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资产支持证券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合。

5.45 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合。

5.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合。

5.47 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组合

注:本基金未持有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组合。

5.48 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合。

5.49 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贵金属投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合。

5.50 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资产支持证券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合。

5.51 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合。

5.52 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资组合。

5.53 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组合

注:本基金未持有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组合。

5.54 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合。

5.55 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贵金属投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合。

5.56 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资产支持证券投资组合

注:本基金未持有按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合。