富国优化增强债券型证券投资基金

【2012】年度报告摘要

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（简称中国建设银行）
送出日期：	2013年03月26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同意，并由董事长签发。

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3月22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年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国优化增强债券	
基金主代码	100035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年06月10日	
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（简称中国建设银行）	
报告期末基金份额总额	569,833,842.49份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	富国优化增强债券A/B级	富国优化增强债券C级
下属两级基金的交易代码	100035	100035
报告期末下属两级基金的份额总额	257,652,207.83份	312,181,634.66份

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置，在债券投资过程中突出主动性的投资管理。 本基金通过对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势的客观判断，合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券，以及风险收益特征优异的可转换债、可分离债券、可交换债券等，加以对国家债券等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略。在保证基金流动性的前提下，积极把握投资机会，获取各类债券的超额投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司（简称中国建设银行）
信息披露负责人	姓名	范伟隽	田青
	联系电话	021-20361818	010-67595096
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686，4008880688	010-67595096
传真		021-20361616	010-67595853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	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层 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

①富国优增A/B级

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	6,467,214.57	-26,057,665.42	43,763,291.68
本期利润	16,089,897.89	-71,029,188.56	56,244,641.75
加权平均基金份额本期利润	0.0529	-0.1088	0.1330
本期基金份额净值增长率	5.45%	-10.07%	14.65%
3.1.2期末数据和指标	2012年12月31日	2011年12月31日	2010年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.0372	-0.0578	0.0288
期末基金资产净值	264,397,008.40	332,861,641.05	696,976,561.78
期末基金份额净值	1.026	0.973	1.082

②富国优增C级

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	5,695,253.61	-31,180,313.69	56,109,312.60
本期利润	15,192,463.94	-53,662,833.77	72,457,940.09
加权平均基金份额本期利润	0.0457	-0.1064	0.1244
本期基金份额净值增长率	4.99%	-10.43%	14.07%
3.1.2期末数据和指标	2012年12月31日	2011年12月31日	2010年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.0526	-0.0690	0.0212
期末基金资产净值	315,312,238.15	345,321,121.32	609,141,325.63
期末基金份额净值	1.010	0.962	1.074

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

①富国优增A/B级

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	4.27%	0.42%	1.67%	0.13%	2.60%	0.29%
过去六个月	1.48%	0.37%	0.86%	0.13%	0.62%	0.24%
过去一年	5.45%	0.32%	4.18%	0.13%	1.27%	0.19%
过去三年	8.72%	0.40%	7.08%	0.15%	1.64%	0.25%
自基金合同生效日起至今	8.94%	0.38%	9.43%	0.16%	-0.49%	0.22%

②富国优增C级

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	4.23%	0.42%	1.67%	0.13%	2.56%	0.29%
过去六个月	1.30%	0.38%	0.86%	0.13%	0.44%	0.25%
过去一年	4.99%	0.32%	4.18%	0.13%	0.81%	0.19%
过去三年	7.28%	0.40%	7.08%	0.15%	0.20%	0.25%
自基金合同生效日起至今	7.28%	0.38%	9.43%	0.16%	-2.15%	0.22%

注：本基金合同生效日为2009年6月10日。

本基金根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=中债综合指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成份债券包括国家债券、金融债券、央行票据等所有主要债券种类，具有广泛的市场代表性，能够反应中国债券市场的总体走势。沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（benchmark）按下列公式计算：

benchmark = 90% * [中债综合指数t/（中债综合指数t-1）-1]+ 10% * [沪深300指数t/沪深300指数t-1）-1]；

其中，t=1，2，3，…，T，T表示时间截至日；

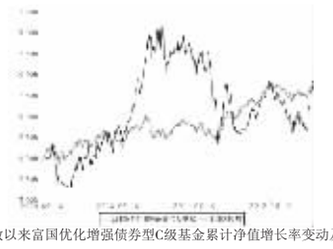
期间T日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

benchmarkT = [∏(Tt=1 (1+benchmark t))]-1

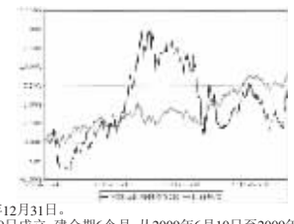
其中，T=2，3，4，…；∏(Tt=1 (1+benchmark t))表示t日至T日的(1+benchmark t)数学连乘。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计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

①）自基金合同生效以来富国优化增强债券型A/B级基金累计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



②）自基金合同生效以来富国优化增强债券型C级基金累计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

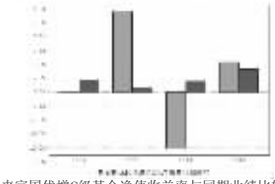


注：截止日期为2012年12月31日。

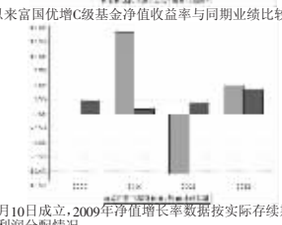
本基金于2009年6月10日成立，建仓期6个月，从2009年6月10日至2009年12月9日建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

①自基金合同生效以来富国优增A/B级基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



②）自基金合同生效以来富国优增C级基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于2009年6月10日成立，2009年净值增长率数据按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

①富国优增A/B级

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	-	-	-	-	-
2011年	-	-	-	-	-
2010年	0.650	32,060,616.35	4,258,169.57	36,318,785.92	2次分红
合计	0.650	32,060,616.35	4,258,169.57	36,318,785.92	-

②富国优增C级

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	-	-	-	-	-
2011年	-	-	-	-	-
2010年	0.650	27,665,193.74	8,486,585.69	36,151,779.43	2次分红
合计	0.650	27,665,193.74	8,486,585.69	36,151,779.43	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

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十家基金管理公司之一，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成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截止2012年12月31日，本基金管理人共管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、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、富国天盈分级债券型证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业股票型证券投资基金、富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强收益定期开放债券型证券投资基金三十二只证券投资基金。

4.1.2 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈曙亮	本基金基金经理兼任富国天利增长债券投资基金基金经理、富国可转换债券证券投资基金基金经理	2012-12-18	-	5年	硕士，2008年6月至2012年1月任富国基金管理有限公司助理定量研究员、定量研究员；2012年2月至4月任富国基金管理有限公司年金投资经理；2012年7月任富国天利增长债券投资基金基金经理、富国可转换债券证券投资基金基金经理；2012年12月任富国优化增强债券基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
钟智伦	本基金前任基金经理	2009-06-10	2012-12-18	19年	硕士，曾任平安证券有限责任公司部门经理；上海新世纪投资服务有限公司研究员；海通证券股份有限公司投资经理；2005年5月任富国基金管理有限公司债券研究员；2006年6月至2009年3月任富国天时基金经理；2008年10月至今任富国天丰基金经理；2009年6月至2012年12月任富国优化增强债券基金基金经理；2011年12月至今任富国产业债债券型证券投资基金基金经理；兼任固定收益投资副总监。具有基金从业资格，中国国籍。

注：1、上述表格内基金经理的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。

证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

2、本公司于2012年12月18日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告，聘任陈曙亮先生担任本基金基金经理，钟智伦先生不再担任本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国优化增强债券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》、《富国优化增强债券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，以为投资者减少和分散风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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（1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。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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。

4.3.3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未出现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 管理人对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

2012年，优增的表现相对一般。这主要受损于较高的风险资产配置，年末受权益市场上涨，组合收益有较明显的回升。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日，本基金A/B级份额净值为1.026元，份额累计净值为1.091元；本基金C级份额净值为1.010元，份额累计净值为1.075元。报告期内，本基金A/B级份额净值增长率为5.45%，同期业绩比较基准收益率为4.18%；本基金C级份额净值增长率为4.99%，同期业绩比较基准收益率为4.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计2013年国内经济企稳，缓慢复苏。GDP同比增速略有回升但幅度不大，全年保持在7.5%—8%区间波动。通胀水平仍然保持相对可控的状态，债券的收益率可能在当前的估值中枢上下的相对较小区域变动。权益市场至少存在估值修复的行情

我们对于信用债的投资仍然以精选个券为主，转债和股票的投资保持适度的灵活性，力争给投资者带来确定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金《基金合同》约定，本基金本期不进行收益分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富国优化增强债券型证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末（2012年12月31日）	上年度末（2011年12月31日）
资 产：		
银行存款	9,113,759.60	339,286.63
结算备付金	20,865,116.16	54,436,479.76
存出保证金	270,999.60	284,509.21
交易性金融资产	883,985,919.40	730,341,354.82
其中：股票投资	86,678,560.60	51,079,524.78
基金投资	-	-
债券投资	797,307,358.80	679,261,830.04
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	5,487,948.61	24,545,327.43
应收利息	10,381,915.48	12,797,283.53
应收股利	-	-
应收申购款	559,858.26	8,549.83
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	930,665,517.11	822,752,791.21
负债和所有者权益	本期末（2012年12月31日）	上年度末（2011年12月31日）
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	341,500,000.00	120,999,942.40
应付证券清算款	5,789,341.29	20,771,453.50
应付赎回款	1,914,215.81	827,090.27
应付管理人报酬	329,140.43	437,370.54
应付托管费	94,040.10	124,963.03
应付销售服务费	97,805.38	121,073.46
应付交易费用	64,092.99	97,592.62
应交税费	993,979.20	993,979.20
应付利息	-	5,625.90
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	173,655.36	190,937.92
负债合计	350,956,270.56	144,570,028.84
所有者权益：		
实收基金	569,833,842.49	701,070,851.37
未分配利润	9,875,404.06	-22,888,089.00
所有者权益合计	579,709,246.55	678,182,762.37
负债和所有者权益总计	930,665,517.11	822,752,791.21

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额总额569,833,842.49份，其中A/B类基金份额总额257,652,207.83份，基金份额净值1.026元；C类基金份额总额312,181,634.66份，基金份额净值1.010元。

7.2 利润表

会计主体：富国优化增强债券型证券投资基金

本报告期：2012年01月01日至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）
一、收入	47,208,929.04	-100,219,205.22
1.利息收入	24,252,595.26	36,495,532.04
其中：存款利息收入	492,425.65	664,502.70
债券利息收入	23,083,779.45	35,831,029.34
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	676,390.16	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,798,614.10	-69,499,683.48
其中：股票投资收益	-10,543,537.12	-44,255,693.16
基金投资收益	-	-
债券投资收益	13,565,515.57	-27,345,304.92
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	776,635.65	2,101,314.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	19,119,893.65	-67,454,043.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	37,826.03	238,989.44
减：二、费用	15,926,567.21	24,472,817.11
1.管理人报酬	4,412,823.32	8,476,714.94
2.托管费	1,260,806.62	2,421,918.46
3.销售服务费	1,307,528.00	2,095,301.56
4.交易费用	707,710.97	1,740,586.73
5.利息支出	8,042,526.16	9,514,116.04
其中：卖出回购金融资产支出	8,042,526.16	9,514,116.04
6.其他费用	195,172.14	224,179.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	31,282,361.83	-124,692,022.33
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	31,282,361.83	-124,692,022.33

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国优化增强债券型证券投资基金

本报告期：2012年01月01日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	701,070,851.37	-22,888,089.00	678,182,762.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,282,361.83	31,282,361.83
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-131,237,008.88	1,481,131.23	-129,755,877.65
其中：1.基金申购款	203,609,259.95	-1,051,073.52	202,558,186.43
2.基金赎回款	-334,846,268.83	2,532,204.75	-332,314,064.08
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	569,833,842.49	9,875,404.06	579,709,246.55
项目	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,211,151,442.82	94,966,444.59	1,306,117,887.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-124,692,022.33	-124,692,022.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-510,080,591.45	6,837,488.74	-503,243,102.71
其中：1.基金申购款	862,418,043.80	61,990,649.11	924,408,692.91
2.基金赎回款	-1,372,498,635.25	-55,153,160.37	-1,427,651,795.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	701,070,851.37	-22,888,089.00	678,182,762.37

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

窦玉明 林志松 雷青松

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

7.4.2会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.3关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司（“申银万国”）	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）		上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	41,912,311.57	9.10	20,931,969.96	2.00
申银万国	19,424,701.96	4.22	-	-

7.4.4.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）		上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
海通证券	884,255,310.00	53.79	717,497,730.13	22.90
申银万国	9,794,558.16	0.60	-	-

7.4.4.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）		上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
海通证券	9,016,943,000.00	22.79	8,153,000,000.00	11.91
申银万国	1,440,500,000.00	3.64	-	-

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
海通证券	36,258.86	9.10	4,834.65	7.57
申银万国	16,684.41	4.19	0.00	0.00
关联方名称	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
海通证券	17,083.32	1.98	0.00	0.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.5 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	4,412,823.32	8,476,714.94
其中：支付销售机构的客户维护费	907,219.60	1,374,162.40

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.7%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.2.6 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	1,260,806.62	2,421,918.46

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.2%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.2.7 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）当期发生的基金应支付的销售服务费		
	AB级	C级	合计
富国基金管理有限公司	-	1,307,528.00	1,307,528.00
合计	-	1,307,528.00	1,307,528.00

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）当期发生的基金应支付的销售服务费		
	AB级	C级	合计
富国基金管理有限公司	-	2,095,301.56	2,095,301.56
合计	-	2,095,301.56	2,095,301.56

注：本基金A类和B类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.4%/当年天数

H为C类基金每日应支付的基金销售服务费

E为C类基金前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.5 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.6 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）		上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	9,113,759.60	182,819.90	339,286.63	228,949.89

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

7.4.5 期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.5 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2012年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.5.3.6 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券余额人民币341,500,000.00元，于2013年1月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所