

# 富国沪深 300 增强证券投资基金

二〇一二年半年度报告

2012 年 06 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

送出日期： 2012 年 08 月 25 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。本半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。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介 .....	5
2.1	基金基本情况 .....	5
2.2	基金产品说明 .....	5
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4	信息披露方式 .....	6
2.5	其他相关资料 .....	6
§3	主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2	基金净值表现 .....	7
§4	管理人报告 .....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
§5	托管人报告 .....	11
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	11
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ...	11
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	12
§6	半年度财务报表(未经审计) .....	12
6.1	资产负债表 .....	12
6.2	利润表.....	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4	报表附注.....	15
§7	投资组合报告 .....	28
7.1	期末基金资产组合情况.....	28
7.2	期末按行业分类的股票投资组合 .....	28
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	30
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	34
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	35
7.6	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 .....	36
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	36
7.8	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 .....	36
7.9	投资组合报告附注 .....	36
§8	基金份额持有人信息 .....	37
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	37
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	37
§9	开放式基金份额变动 .....	37

§10	重大事件揭示.....	37
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	37
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	37
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	38
10.4	基金投资策略的改变.....	38
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	38
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	38
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
10.8	其他重大事件 .....	41
§11	备查文件目录.....	41

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国沪深 300 增强证券投资基金
基金简称	富国沪深 300 指数增强
基金主代码	100038
交易代码	前端交易代码：100038 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	2009 年 12 月 16 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	7,156,466,249.23 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林志松	赵会军
	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、4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		陈敏	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富国基金管理有限公司	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

## § 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 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	16,916,439.09
本期利润	318,539,659.85
加权平均基金份额本期利润	0.0514
本期加权平均净值利润率	5.94%
本期基金份额净值增长率	8.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年06月30日)
期末可供分配利润	-1,069,309,005.45
期末可供分配基金份额利润	-0.1494
期末基金资产净值	6,087,157,243.78
期末基金份额净值	0.851
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-14.90%

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。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 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	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
过去一个月	-5.13%	1.06%	-6.04%	1.04%	0.91%	0.02%
过去三个月	2.28%	1.09%	0.65%	1.07%	1.63%	0.02%
过去六个月	8.68%	1.27%	5.52%	1.26%	3.16%	0.01%
过去一年	-13.78%	1.30%	-16.94%	1.28%	3.16%	0.02%
自基金合同生效日起至今	-14.90%	1.37%	-27.06%	1.36%	12.16%	0.01%

注：

本基金根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。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。

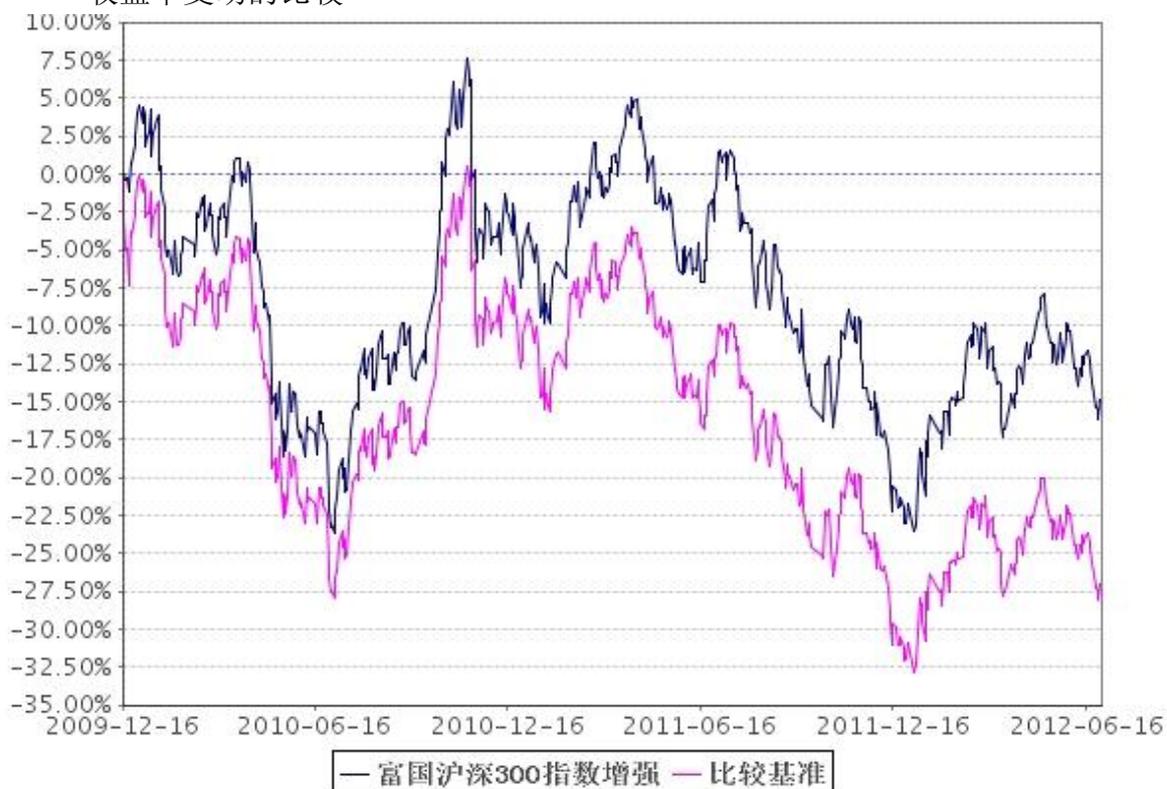
本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（benchmark<sub>t</sub>）

按下列公式计算： $benchmark_t = 95\% * [沪深300指数_t / (沪深300指数_{t-1}) - 1] + [(1+0.015)^{(1/250)} - 1]$ ；其中，t=1,2,3,...,T，T表示时间截至日；期间T日收

（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算： $benchmark_T = [\prod_{t=1}^T (1+benchmark_t)] - 1$ 其中，

T=2,3,4,...； $\prod_{t=1}^T (1+benchmark_t)$ 表示t日至T日的(1+benchmark<sub>t</sub>)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



注：截至日期为 2012 年 6 月 30 日。本基金于 2009 年 12 月 16 日成立，建仓期 6 个月，从 2009 年 12 月 16 日至 2010 年 6 月 15 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 6 月 30 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二十八只证券投资基金。

#### 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		
李笑薇	本基金基金经理兼任公司总经理助理、量化与海外投资部总经理、富国中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理	2009-12-23	—	10 年	博士，曾任摩根士丹利资本国际 Barra 公司 (MSCIBARRA), BARRA 股票风险评估部高级研究员；巴克莱国际投资管理公司 (BarclaysGlobal Investors), 大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；2009 年 6 月加入富国基金管理有限公司，2011 年 1 月至 2012 年 5 月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，2009 年 12 月至今任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理，2011 年 10 月至今任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；兼任富国基金公司总经理助理、量化与海外投资部总经理；具有中国基金从业资格，美国国籍。

注：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。

#### 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沪深 300 增强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》、《富国沪深 300 增强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，力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 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。

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 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

在本报告期内，本基金在投资中遇到了较多申购赎回，较大地增加了本基金的交易成本。

值得欣慰的是本基金采取了量化增强策略获得了较好的效果，在种种不利的因素下，最后本基金在报告期内仍然获得了3.75%累积超额收益（相对于95%\*沪深300指数）。而且从稳定性来看，上半年的6个月中，全部都战胜了基准，量化增强策略的整体效果符合我们预期。

回顾 2012 年上半年，欧债危机随着希腊第一次大选失败而愈演愈烈，全球经济再次陷入二次深度衰退的风险之中。国内尽管国内通货膨胀率从高位回落，货币政策也开始明确放松，但投资者更加担心经济增速减缓的风险。市场的悲观情绪在二季度再度攀升，整个上半年市场走势呈现出先扬后抑，沪深 300 指数上半年上涨 4.94%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.851 元，份额累计净值为 0.851 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 8.68%，同期业绩比较基准收益率为 5.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年下半年，货币政策可能进一步放松，通胀企稳，海外经济已经从底部开始复苏。市场大部分的悲观预期已经充分反映，目前市场点位下具有较大的安全边际，部分低估值大盘蓝筹股以及绩优成长股仍然具备投资价值。综合来看，下半年市场可能呈现震荡上行走势。

#### 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投资基金行业从业经验。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

本基金本报告期末进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

## § 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

2012 年上半年，本基金托管人在对富国沪深 300 增强证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

2012 年上半年，富国沪深 300 增强证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国沪深 300 增强证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，富国沪深 300 增强证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国沪深 300 增强证券投资基金 2012 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

二〇一二年八月二十三日

## § 6 半年度财务报表(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国沪深 300 增强证券投资基金

报告截止日：2012 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2012 年 06 月 30 日)	上年度末 (2011 年 12 月 31 日)
<b>资 产：</b>		
银行存款	332,227,954.66	221,501,807.28
结算备付金	11,205,697.60	13,021,011.07
存出保证金	2,579,862.49	3,231,498.41
交易性金融资产	5,728,355,540.60	3,940,929,446.00
其中：股票投资	5,728,355,540.60	3,940,929,446.00
基金投资	—	—
债券投资	—	—
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	—	—
应收利息	63,547.38	48,064.39
应收股利	278,581.81	—
应收申购款	24,312,668.04	1,002,306.01
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	6,099,023,852.58	4,179,734,133.16
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2012 年 06 月 30 日)</b>	<b>上年度末 (2011 年 12 月 31 日)</b>
<b>负 债：</b>		
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	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	2,519,112.66	1,627,242.27
应付管理人报酬	5,014,771.53	3,474,066.05
应付托管费	902,658.86	625,331.89

应付销售服务费	—	—
应付交易费用	3,011,252.63	4,672,317.00
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	418,813.12	443,530.85
负债合计	11,866,608.80	10,842,488.06
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7,156,466,249.23	5,325,691,669.25
未分配利润	-1,069,309,005.45	-1,156,800,024.15
所有者权益合计	6,087,157,243.78	4,168,891,645.10
负债和所有者权益总计	6,099,023,852.58	4,179,734,133.16

注：报告截止日 2012 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.851 元，基金份额总额 7,156,466,249.23 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国沪深 300 增强证券投资基金

本报告期：2012 年 01 月 01 日至 2012 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2012 年 01 月 01 日 至 2012 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2011 年 01 月 01 日至 2011 年 06 月 30 日)
<b>一、收入</b>	362,807,441.45	151,710,539.33
1. 利息收入	1,117,876.06	580,497.84
其中：存款利息收入	1,117,876.06	576,717.65
债券利息收入	—	3,780.19
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	58,429,419.04	34,788,007.98
其中：股票投资收益	-11,348,758.65	2,698,837.48
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	427,171.86
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	69,778,177.69	31,661,998.64
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	301,623,220.76	114,257,912.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,636,925.59	2,084,120.81
<b>减：二、费用</b>	44,267,781.60	34,136,727.18
1. 管理人报酬	26,428,524.55	12,208,919.56
2. 托管费	4,757,134.44	2,197,605.48

3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	12,550,017.35	19,426,055.59
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	532,105.26	304,146.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	318,539,659.85	117,573,812.15
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	318,539,659.85	117,573,812.15

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国沪深300增强证券投资基金

本报告期：2012年01月01日至2012年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2012年01月01日至2012年06月30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）	5,325,691,669.25	-1,156,800,024.15	4,168,891,645.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	318,539,659.85	318,539,659.85
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）	1,830,774,579.98	-231,048,641.15	1,599,725,938.83
其中：1. 基金申购款	3,325,777,411.37	-416,526,136.61	2,909,251,274.76
2. 基金赎回款	-1,495,002,831.39	185,477,495.46	-1,309,525,335.93
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）	7,156,466,249.23	-1,069,309,005.45	6,087,157,243.78
项目	上年度可比期间 (2011年01月01日至2011年06月30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）	2,597,394,413.17	-127,805,092.57	2,469,589,320.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	117,573,812.15	117,573,812.15
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）	223,053,578.70	-26,111,107.03	196,942,471.67
其中：1. 基金申购款	1,903,583,925.12	-39,357,435.97	1,864,226,489.15
2. 基金赎回款	-1,680,530,346.42	13,246,328.94	-1,667,284,017.48
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）	2,820,447,991.87	-36,342,387.45	2,784,105,604.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

窦玉明	林志松	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富国沪深 300 增强证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2009】1106 号文《关于同意富国沪深 300 增强证券投资基金募集的批复》的核准,由富国基金管理有限公司作为基金管理人于 2009 年 11 月 11 日至 2009 年 12 月 11 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2009)验字第 60467606\_B06 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2009 年 12 月 16 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 3,489,423,164.75 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 486,138.27 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 3,489,909,303.02 元,折合 3,489,909,303.02 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,股票资产投资比例不低于基金资产的 90%,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%;保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+1.5%(指年收益率,评价时按期间折算)。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2012 年 6

月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 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。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

##### (2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

##### (3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2012年06月30日）
活期存款	332,227,954.66
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	332,227,954.66

注：本基金本期末未投资于定期存款和其他存款。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2012年06月30日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,973,302,255.17	5,728,355,540.60	-244,946,714.57
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	5,973,302,255.17	5,728,355,540.60	-244,946,714.57

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2012年06月30日）
应收活期存款利息	59,009.04
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	4,538.34
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
其他	—
合计	63,547.38

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2012年06月30日）
交易所市场应付交易费用	3,011,252.63
银行间市场应付交易费用	—
合计	3,011,252.63

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2012年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	9,834.72
其他	79,500.00
预提审计费	49,726.04
预提信息披露费	49,726.04
应付指数使用费	230,026.32
合计	418,813.12

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,325,691,669.25	5,325,691,669.25
本期申购	3,325,777,411.37	3,325,777,411.37
本期赎回（以“-”号填列）	-1,495,002,831.39	-1,495,002,831.39
本期末	7,156,466,249.23	7,156,466,249.23

注：本期申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-350,405,113.03	-806,394,911.12	-1,156,800,024.15
本期利润	16,916,439.09	301,623,220.76	318,539,659.85
本期基金份额交易产生的变动数	-139,642,810.72	-91,405,830.43	-231,048,641.15
其中：基金申购款	-253,480,809.05	-163,045,327.56	-416,526,136.61
基金赎回款	113,837,998.33	71,639,497.13	185,477,495.46
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-473,131,484.66	-596,177,520.79	-1,069,309,005.45

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年06月30日）
活期存款利息收入	1,041,475.50
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	76,400.56
其他	—

合计	1,117,876.06
----	--------------

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年06月30日）
卖出股票成交总额	3,569,699,830.57
减：卖出股票成本总额	3,581,048,589.22
买卖股票差价收入	-11,348,758.65

#### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本期无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本期无权证投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年06月30日）
股票投资产生的股利收益	69,778,177.69
基金投资产生的股利收益	—
合计	69,778,177.69

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2012年01月01日至2012年06月30日）
1. 交易性金融资产	301,623,220.76
股票投资	301,623,220.76
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
合计	301,623,220.76

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年06月30日）
基金赎回费收入	1,573,614.03
转换费收入	63,311.56
合计	1,636,925.59

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年06月30日）
交易所市场交易费用	12,550,017.35
银行间市场交易费用	—
合计	12,550,017.35

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年06月30日）
审计费用	49,726.04
信息披露费	49,726.04
银行汇划费用	796.76
指数使用费	422,856.42
债券帐户维护费	9,000.00
合计	532,105.26

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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（“申银万国证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司	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

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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06月30日）		上年度可比期间（2011年01月01日至2011年06月30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	1,353,876,445.23	15.68	2,960,721,841.39	23.19
申银万国	982,490,594.13	11.38	4,344,983,412.54	34.03

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方进行回购交易。

6.4.10.1.5 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06月30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	1,150,791.38	15.82	536,245.74	17.81
申银万国	820,618.01	11.28	436,342.55	14.49
关联方名称	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年06月30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	2,516,609.05	23.56	707,026.46	15.33
申银万国	3,591,759.54	33.63	1,897,569.30	41.15

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年06月30日）	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	26,428,524.55	12,208,919.56
其中：支付销售机构的客户维护费	1,804,308.85	1,672,648.85

注：本基金的管理费按该基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年06月30日）	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	4,757,134.44	2,197,605.48

注：本基金的托管费按基金资产净值的0.18%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.18\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过银行间同业市场与关联方进行债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期(2012年01月01日至 2012年06月30日)	上年度可比期间 (2011年01月01日至2011 年06月30日)
基金合同生效日(2009年 12月16日)持有的基金份额	—	—
期初持有的基金份额	20,002,200.00	20,002,200.00
期间申购/买入总份额	21,786,492.37	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	41,788,692.37	20,002,200.00
期末持有的基金份额占基 金总份额比例	0.58%	0.71%

注：本基金管理人认购本基金份额的费率按照本基金发售公告的条款执行，不存在费率优惠的情况。本基金管理人本期投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

##### 6.4.10.4.2 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本报告期末和上年度可比期间末均未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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06月 30日)		上年度可比期间 (2011年01月01日至2011年06月30 日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限 公司	332,227,954.66	1,041,475.50	140,683,766.34	447,819.58

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2012年06月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限股票。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000059	辽通化工	2012-06-26	筹划重大事项	7.91	2012-07-03	8.15	6,050,921	57,776,473.73	47,862,785.11	

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，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；没有因正回购而作为抵押的银行间市场债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额；没有因交易所市场债券正回购而作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

##### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2012年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	332,227,954.66	—	—	—	—	—	332,227,954.66
结算备付金	11,205,697.60	—	—	—	—	—	11,205,697.60
存出保证金	—	—	—	—	—	2,579,862.49	2,579,862.49
交易性金融资产	—	—	—	—	—	5,728,355,540.60	5,728,355,540.60
应收利息	—	—	—	—	—	63,547.38	63,547.38
应收股利	—	—	—	—	—	278,581.81	278,581.81
应收申购款	24,312,668.04	—	—	—	—	—	24,312,668.04
资产总计	367,746,320.30	—	—	—	—	5,731,277,532.28	6,099,023,852.58
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	2,519,112.66	2,519,112.66
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	5,014,771.53	5,014,771.53
应付托管费	—	—	—	—	—	902,658.86	902,658.86
应付交易费用	—	—	—	—	—	3,011,252.63	3,011,252.63
其他负债	—	—	—	—	—	418,813.12	418,813.12
负债总计	—	—	—	—	—	11,866,608.80	11,866,608.80
利率敏感度缺口	367,746,320.30	—	—	—	—	5,719,410,923.48	6,087,157,243.78
上年度末（2011年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	221,501,807.28	—	—	—	—	—	221,501,807.28
结算备付金	13,021,011.07	—	—	—	—	—	13,021,011.07
存出保证金	—	—	—	—	—	3,231,498.41	3,231,498.41
交易性金融资产	—	—	—	—	—	3,940,929,446.00	3,940,929,446.00
应收利息	—	—	—	—	—	48,064.39	48,064.39
应收申购款	1,002,306.01	—	—	—	—	—	1,002,306.01
资产总计	235,525,124.36	—	—	—	—	3,944,209,008.80	4,179,734,133.16
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	1,627,242.27	1,627,242.27
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	3,474,066.05	3,474,066.05
应付托管费	—	—	—	—	—	625,331.89	625,331.89
应付交易费用	—	—	—	—	—	4,672,317.00	4,672,317.00
其他负债	—	—	—	—	—	443,530.85	443,530.85
负债总计	—	—	—	—	—	10,842,488.06	10,842,488.06
利率敏感度缺口	235,525,124.36	—	—	—	—	3,933,366,520.74	4,168,891,645.10

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产的其他变量不变，仅利率发生变动		
	2. 利率变动范围合理		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2012年06月30日）	上年度末（2011年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	0.00	0.00
	2. 基准点利率减少0.1%	0.00	0.00

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%；保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。于2012年6月30日和2011年12月31日，本基金面临的整体市场价格风险。

金额单位：人民币元

项目	本期末（2012年06月30日）		上年度末（2011年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	5,728,355,540.60	94.11	3,940,929,446.00	94.53
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	5,728,355,540.60	94.11	3,940,929,446.00	94.53

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：元）	
		本期末（2012年06月30日）	上年度末（2011年12月31日）
	1. 业绩比较基准减少 1%	-60,797,515.92	-42,026,555.52
2. 业绩比较基准增加 1%	60,797,515.92	42,026,555.52	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,728,355,540.60	93.92
	其中：股票	5,728,355,540.60	93.92
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	343,433,652.26	5.63
6	其他各项资产	27,234,659.72	0.45
7	合计	6,099,023,852.58	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

积极投资按行业分类的股票投资组合：

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—

B	采掘业	40,687,673.60	0.67
C	制造业	455,059,997.04	7.48
C0	食品、饮料	9,823,610.80	0.16
C1	纺织、服装、皮毛	16,809,154.33	0.28
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	298,383.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,799,332.50	0.23
C5	电子	127,585,074.64	2.10
C6	金属、非金属	7,808,205.26	0.13
C7	机械、设备、仪表	218,270,087.55	3.59
C8	医药、生物制品	60,666,148.96	1.00
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	3,254,730.00	0.05
F	交通运输、仓储业	100,587,441.49	1.65
G	信息技术业	6,544,836.02	0.11
H	批发和零售贸易	3,298,799.01	0.05
I	金融、保险业	26,607,183.68	0.44
J	房地产业	12,223,399.62	0.20
K	社会服务业	—	—
L	传播与文化产业	12,225,312.50	0.20
M	综合类	4,145,319.00	0.07
	合计	664,634,691.96	10.92

### 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	530,863,763.99	8.72
C	制造业	1,768,618,437.26	29.05
C0	食品、饮料	425,117,197.00	6.98
C1	纺织、服装、皮毛	990,375.48	0.02
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	82,998,753.96	1.36
C5	电子	66,803,502.20	1.10
C6	金属、非金属	412,073,273.23	6.77
C7	机械、设备、仪表	616,837,346.57	10.13
C8	医药、生物制品	163,797,988.82	2.69
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	94,287,512.70	1.55

E	建筑业	259,064,296.34	4.26
F	交通运输、仓储业	72,256,836.49	1.19
G	信息技术业	77,543,682.28	1.27
H	批发和零售贸易	367,384,630.12	6.04
I	金融、保险业	1,569,045,489.21	25.78
J	房地产业	269,123,866.20	4.42
K	社会服务业	41,780,852.73	0.69
L	传播与文化产业	12,264,890.80	0.20
M	综合类	1,486,590.52	0.02
	合计	5,063,720,848.64	83.19

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	601318	中国平安	5,911,493	270,391,689.82	4.44
2	600016	民生银行	40,227,596	240,963,300.04	3.96
3	601166	兴业银行	15,231,477	197,704,571.46	3.25
4	600000	浦发银行	22,998,553	186,978,235.89	3.07
5	600036	招商银行	16,325,241	178,271,631.72	2.93
6	600030	中信证券	12,165,502	153,650,290.26	2.52
7	601088	中国神华	6,342,634	142,582,412.32	2.34
8	601668	中国建筑	42,602,996	142,294,006.64	2.34
9	000157	中联重科	13,282,274	133,221,208.22	2.19
10	000002	万科A	14,043,378	125,126,497.98	2.06
11	600015	华夏银行	12,766,462	120,898,395.14	1.99
12	000568	泸州老窖	2,844,015	120,330,274.65	1.98
13	600104	上汽集团	8,300,100	118,608,429.00	1.95
14	600519	贵州茅台	493,185	117,945,192.75	1.94
15	600028	中国石化	17,801,523	112,149,594.90	1.84
16	600019	宝钢股份	24,899,248	107,564,751.36	1.77
17	600739	辽宁成大	6,772,975	105,658,410.00	1.74
18	600362	江西铜业	4,213,882	100,753,918.62	1.66
19	601186	中国铁建	22,110,004	98,389,517.80	1.62
20	600196	复星医药	9,355,979	96,460,143.49	1.58
21	600795	国电电力	34,921,301	94,287,512.70	1.55
22	600153	建发股份	12,957,548	92,776,043.68	1.52

23	000876	新希望	6,029,590	90,323,258.20	1.48
24	601998	中信银行	21,946,114	87,784,456.00	1.44
25	600655	豫园商城	10,182,477	80,237,918.76	1.32
26	600500	中化国际	11,498,118	77,727,277.68	1.28
27	000858	五粮液	2,295,050	75,185,838.00	1.24
28	000001	深发展A	4,892,785	74,174,620.60	1.22
29	600489	中金黄金	3,419,358	73,584,584.16	1.21
30	600376	首开股份	5,438,126	72,000,788.24	1.18
31	000778	新兴铸管	10,453,091	69,931,178.79	1.15
32	600741	华域汽车	7,107,274	63,752,247.78	1.05
33	600703	三安光电	4,673,126	63,601,244.86	1.04
34	601899	紫金矿业	16,141,433	62,628,760.04	1.03
35	600219	南山铝业	9,191,615	61,583,820.50	1.01
36	000651	格力电器	2,911,309	60,700,792.65	1.00
37	601717	郑煤机	5,047,909	58,555,744.40	0.96
38	000630	铜陵有色	2,999,624	57,892,743.20	0.95
39	600582	天地科技	3,984,488	57,575,851.60	0.95
40	601866	中海集运	21,733,795	54,986,501.35	0.90
41	601918	国投新集	4,249,687	51,888,678.27	0.85
42	000425	徐工机械	3,538,411	50,740,813.74	0.83
43	000021	长城开发	9,077,050	48,834,529.00	0.80
44	000059	辽通化工	6,050,921	47,862,785.11	0.79
45	601117	中国化学	7,241,049	41,780,852.73	0.69
46	600048	保利地产	3,575,473	40,545,863.82	0.67
47	601328	交通银行	7,822,182	35,512,706.28	0.58
48	600547	山东黄金	1,043,940	34,282,989.60	0.56
49	600089	特变电工	4,528,798	30,659,962.46	0.50
50	600062	华润双鹤	1,447,834	27,624,672.72	0.45
51	600123	兰花科创	1,501,471	27,116,566.26	0.45
52	600383	金地集团	3,433,580	22,249,598.40	0.37
53	000422	湖北宜化	1,752,029	21,462,355.25	0.35
54	002304	洋河股份	158,548	21,332,633.40	0.35
55	601688	华泰证券	1,943,500	20,406,750.00	0.34
56	600170	上海建工	2,474,195	17,863,687.90	0.29
57	601299	中国北车	3,457,495	13,864,554.95	0.23
58	600352	浙江龙盛	2,386,320	13,673,613.60	0.22
59	601607	上海医药	1,279,052	13,647,484.84	0.22
60	002073	软控股份	1,563,400	13,101,292.00	0.22
61	600546	山煤国际	622,252	13,017,511.84	0.21
62	600009	上海机场	1,003,751	12,787,787.74	0.21
63	601098	中南传媒	1,280,260	12,264,890.80	0.20

64	600694	大商股份	328,400	10,984,980.00	0.18
65	601898	中煤能源	1,357,772	10,509,155.28	0.17
66	601766	中国南车	2,108,508	9,614,796.48	0.16
67	600216	浙江医药	376,305	9,464,070.75	0.16
68	600804	鹏博士	1,412,773	8,391,871.62	0.14
69	000063	中兴通讯	581,145	8,112,784.20	0.13
70	000402	金融街	1,167,342	7,622,743.26	0.13
71	600406	国电南瑞	400,993	7,494,559.17	0.12
72	600307	酒钢宏兴	1,946,048	6,752,786.56	0.11
73	600166	福田汽车	765,019	5,469,885.85	0.09
74	000623	吉林敖东	295,843	5,129,917.62	0.08
75	600518	康美药业	313,130	4,828,464.60	0.08
76	000039	中集集团	349,100	4,643,030.00	0.08
77	601919	中国远洋	833,926	3,869,416.64	0.06
78	000538	云南白药	60,271	3,572,864.88	0.06
79	002635	安洁科技	70,075	3,262,692.00	0.05
80	000776	广发证券	77,400	2,308,842.00	0.04
81	600111	包钢稀土	52,170	2,058,628.20	0.03
82	600060	海信电器	108,400	1,822,204.00	0.03
83	002146	荣盛发展	144,805	1,578,374.50	0.03
84	600718	东软集团	168,089	1,447,246.29	0.02
85	002106	莱宝高科	68,762	1,380,053.34	0.02
86	600395	盘江股份	48,043	1,291,395.84	0.02
87	601808	中海油服	74,348	1,227,485.48	0.02
88	002422	科伦药业	25,538	1,191,603.08	0.02
89	600664	哈药股份	156,300	1,030,017.00	0.02
90	600177	雅戈尔	116,652	990,375.48	0.02
91	600432	吉恩镍业	67,200	892,416.00	0.01
92	002001	新和成	40,168	848,749.84	0.01
93	600881	亚泰集团	135,533	745,431.50	0.01
94	600635	大众公用	159,047	741,159.02	0.01
95	600115	东方航空	146,682	613,130.76	0.01
96	600481	双良节能	83,304	596,456.64	0.01
97	601857	中国石油	64,600	584,630.00	0.01
98	601390	中国中铁	201,200	517,084.00	0.01
99	601727	上海电气	82,305	375,310.80	0.01

### 7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	600366	宁波韵升	2,758,495	57,266,356.20	0.94
2	600717	天津港	7,535,089	47,621,762.48	0.78
3	002004	华邦制药	2,087,344	46,965,240.00	0.77
4	000666	经纬纺机	3,801,074	46,449,124.28	0.76
5	601877	正泰电器	2,856,504	43,590,251.04	0.72
6	000970	中科三环	989,948	39,281,136.64	0.65
7	600004	白云机场	5,154,469	35,101,933.89	0.58
8	600157	永泰能源	3,760,620	34,146,429.60	0.56
9	600416	湘电股份	4,798,735	31,863,600.40	0.52
10	600060	海信电器	1,815,748	30,522,723.88	0.50
11	600067	冠城大通	4,555,983	25,376,825.31	0.42
12	600816	安信信托	1,370,664	22,780,435.68	0.37
13	002042	华孚色纺	3,379,570	15,985,366.10	0.26
14	002028	思源电气	1,138,234	12,623,015.06	0.21
15	002638	勤上光电	777,044	12,277,295.20	0.20
16	600350	山东高速	3,421,400	12,180,184.00	0.20
17	600340	华夏幸福	639,118	11,561,644.62	0.19
18	000703	恒逸石化	585,800	9,741,854.00	0.16
19	002350	北京科锐	831,375	9,560,812.50	0.16
20	600312	平高电气	1,020,543	7,143,801.00	0.12
21	000799	酒鬼酒	133,457	6,993,146.80	0.11
22	600495	晋西车轴	605,800	6,451,770.00	0.11
23	600521	华海药业	396,236	5,987,125.96	0.10
24	601000	唐山港	855,958	5,683,561.12	0.09
25	002367	康力电梯	653,426	5,233,942.26	0.09
26	600487	亨通光电	269,953	5,188,496.66	0.09
27	600373	中文传媒	360,925	5,182,883.00	0.09
28	000650	仁和药业	562,900	4,829,682.00	0.08
29	002358	森源电气	383,158	4,823,959.22	0.08
30	600880	博瑞传播	435,550	4,342,433.50	0.07
31	600805	悦达投资	444,300	4,145,319.00	0.07
32	600835	上海机电	463,708	4,048,170.84	0.07
33	601899	紫金矿业	1,036,100	4,020,068.00	0.07
34	002450	康得新	220,000	3,500,200.00	0.06
35	002008	大族激光	532,858	3,346,348.24	0.05
36	600827	友谊股份	291,671	3,298,799.01	0.05
37	600820	隧道股份	365,700	3,254,730.00	0.05
38	601607	上海医药	270,300	2,884,101.00	0.05
39	000001	深发展A	187,400	2,840,984.00	0.05
40	000858	五粮液	86,400	2,830,464.00	0.05

41	600386	北巴传媒	356,200	2,699,996.00	0.04
42	000778	新兴铸管	388,300	2,597,727.00	0.04
43	600219	南山铝业	386,100	2,586,870.00	0.04
44	600123	兰花科创	139,600	2,521,176.00	0.04
45	600582	天地科技	173,800	2,511,410.00	0.04
46	601717	郑煤机	200,100	2,321,160.00	0.04
47	002110	三钢闽光	282,064	1,675,460.16	0.03
48	002635	安洁科技	29,131	1,356,339.36	0.02
49	601818	光大银行	347,100	985,764.00	0.02
50	002133	广宇集团	140,500	661,755.00	0.01
51	000049	德赛电池	18,374	648,602.20	0.01
52	000726	鲁泰A	88,952	644,012.48	0.01
53	000731	四川美丰	83,550	557,278.50	0.01
54	600888	新疆众和	52,650	543,874.50	0.01
55	002371	七星电子	19,312	514,857.92	0.01
56	000962	东方钽业	30,260	404,273.60	0.01
57	002565	上海绿新	23,700	298,383.00	0.00
58	600177	雅戈尔	21,175	179,775.75	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600000	浦发银行	134,083,037.41	3.22
2	600019	宝钢股份	124,911,769.55	3.00
3	601318	中国平安	114,439,578.11	2.75
4	600015	华夏银行	107,643,951.03	2.58
5	600153	建发股份	103,627,981.34	2.49
6	000568	泸州老窖	100,856,224.97	2.42
7	600016	民生银行	96,651,602.31	2.32
8	601186	中国铁建	91,949,578.88	2.21
9	600030	中信证券	88,360,666.98	2.12
10	600500	中化国际	87,668,684.56	2.10
11	600519	贵州茅台	83,278,535.88	2.00
12	601166	兴业银行	79,656,979.47	1.91
13	000858	五粮液	76,755,872.16	1.84
14	601717	郑煤机	73,375,062.13	1.76
15	600219	南山铝业	71,455,780.46	1.71
16	600582	天地科技	69,509,394.47	1.67

17	601866	中海集运	67,833,643.71	1.63
18	600170	上海建工	66,325,604.77	1.59
19	601899	紫金矿业	65,796,766.20	1.58
20	600028	中国石化	64,614,123.49	1.55

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600395	盘江股份	70,750,838.13	1.70
2	601989	中国重工	70,545,053.64	1.69
3	600170	上海建工	69,709,177.48	1.67
4	601288	农业银行	68,555,927.80	1.64
5	600690	青岛海尔	66,162,379.64	1.59
6	600887	伊利股份	65,454,076.30	1.57
7	600547	山东黄金	59,519,940.48	1.43
8	002304	洋河股份	59,470,807.21	1.43
9	000858	五粮液	58,167,758.52	1.40
10	601328	交通银行	55,211,135.02	1.32
11	601727	上海电气	53,612,991.63	1.29
12	600048	保利地产	53,214,540.89	1.28
13	600518	康美药业	52,756,276.20	1.27
14	000685	中山公用	50,705,983.25	1.22
15	600312	平高电气	50,624,201.25	1.21
16	000623	吉林敖东	50,503,076.60	1.21
17	600221	海南航空	49,802,528.00	1.19
18	600804	鹏博士	48,836,476.24	1.17
19	600320	振华重工	48,743,738.04	1.17
20	601898	中煤能源	48,559,791.79	1.16

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,066,851,463.06
卖出股票收入（成交）总额	3,569,699,830.57

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

## 7.6 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。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

## 7.8 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。

## 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

本报告期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。

7.9.2 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。

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。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,579,862.49
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	278,581.81
4	应收利息	63,547.38
5	应收申购款	24,312,668.04
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	27,234,659.72

### 7.9.4 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。

### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前五名积极股票中不存在流通受限情况。

### 7.9.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
49412	144,832.56	5,061,931,216.00	70.73	2,094,535,033.23	29.27

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	12,615,783.33	0.1763

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本基金份额总量为100万份以上。

2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年12月16日)基金份额总额	3,489,909,303.02
报告期期初基金份额总额	5,325,691,669.25
本报告期基金总申购份额	3,325,777,411.37
减:本报告期基金总赎回份额	1,495,002,831.39
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	7,156,466,249.23

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期本基金管理人于2012年4月25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,李长伟先生不再担任本公司督察长,由林志松先生代行督察长职责。

### **10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### **10.4 基金投资策略的改变**

本报告期本基金投资策略无改变。

### **10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### **10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	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 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	973,025,227.68	11.27	—	—	—	—	—	—	820,885.50	11.28	—
方正证券	1	192,382,961.24	2.23	—	—	—	—	—	—	157,111.35	2.16	—
国都证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国海证券	2	777,374,463.82	9.00	—	—	—	—	—	—	662,180.98	9.10	—
国泰君安	2	1,015,841,045.63	11.77	—	—	—	—	—	—	841,042.32	11.56	—
海通证券	1	1,353,876,445.23	15.68	—	—	—	—	—	—	1,150,791.38	15.82	—
宏源证券	2	60,294,769.96	0.70	—	—	—	—	—	—	48,989.35	0.67	—
华宝证券	1	75,302,524.20	0.87	—	—	—	—	—	—	64,006.51	0.88	—
华创证券	1	491,794,222.33	5.70	—	—	—	—	—	—	420,771.31	5.78	—
江海证券	2	32,420,272.53	0.38	—	—	—	—	—	—	27,476.13	0.38	—
瑞银证券	2	571,112,700.76	6.62	—	—	—	—	—	—	483,426.59	6.64	—
上海证券	2	528,045,056.73	6.12	—	—	—	—	—	—	444,476.53	6.11	—
申银万国	2	982,490,594.13	11.38	—	—	—	—	—	—	820,618.01	11.28	—
西部证券	2	360,412,304.13	4.17	—	—	—	—	—	—	303,069.43	4.17	—
英大证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

招商证券	1	781,256,594.28	9.05	—	—	—	—	—	—	665,883.85	9.15	—
中信证券	2	437,260,738.32	5.07	—	—	—	—	—	—	365,134.63	5.02	—
国元证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
齐鲁证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：1. 我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

2. 本期内本基金租用券商交易单元的变更情况：增加华宝证券（上海：24399）、华创证券（上海：26094）、瑞银证券（上海：26205 深圳：391690）、齐鲁证券（上海：25992 深圳：391357）、国元证券（上海：21268）交易单元。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2012年02月28日
2	富国基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2012年04月25日
3	富国基金管理有限公司关于运用自有资金进行基金投资的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2012年05月02日

## § 11 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国沪深 300 增强证券投资基金的文件 2、富国沪深 300 增强证券投资基金基金合同 3、富国沪深 300 增强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、富国沪深 300 增强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	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层	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： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a>