

富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金

二〇一一年半年度报告

2011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：2011年08月27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 2011 年 8 月 25 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 2011 年 1 月 30 日（基金合同生效日）起至 2011 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.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	7
§3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
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.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
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遵规守信情况声明.....	11
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	33
7.1	期末基金资产组合情况.....	33
7.2	期末投资目标基金明细.....	33
7.3	期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.4	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.....	34
7.5	报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.6	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.7	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.....	41
7.8	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.....	41
7.9	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.....	41
7.10	投资组合报告附注.....	41
§8	基金份额持有人信息.....	42
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	42
§9	开放式基金份额变动	42
§10	重大事件揭示	43
10.1	基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4	基金投资策略的改变	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8	其他重大事件	45
§11	备查文件目录	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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：-
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
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	462,078,808.94 份
基金合同存续期	不定期

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
基金主代码	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

2.2 基金产品说明

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。

2.2.1 目标基金产品说明

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。

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	李长伟	赵会军
	联系电话	021-68597788	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		021-68597799	010—66105798
注册地址		上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6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、上海证券报、证券时报
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花园石桥路33号花旗集团大厦5、6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	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 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(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日)
本期已实现收益	15,978,630.74
本期利润	-16,427,317.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0279
本期加权平均净值利润率	-2.81%
本期基金份额净值增长率	-5.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年06月30日)
期末可供分配利润	-23,039,246.38
期末可供分配基金份额利润	-0.0499
期末基金资产净值	439,039,562.56
期末基金份额净值	0.950
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-5.00%

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。本基金合同于 2011 年 1 月 30 日生效，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

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	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	1.17%	1.02%	0.65%	1.00%	0.52%	0.02%
过去三个月	-5.66%	0.94%	-5.38%	0.95%	-0.28%	-0.01%

自基金合同生效起至今	-5.00%	0.76%	0.36%	0.95%	-5.36%	-0.19%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	--------

注：本基金合同于2011年1月30日生效。

根据基金合同中投资策略的有关规定，本基金的业绩比较基准 = 95% × 上证综合指数收益率 + 5% × 银行活期存款税后利率。本基金非货币类证券投资部分的业绩比较基准采用具有代表性的上证综合指数。

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_t) 按下列公式计算：

$benchmark_t = 95\% \times \text{上证综合指数}_t / (\text{上证综合指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times \text{银行活期存款税后利率} / 360$ ；其中， $t=1,2,3,\dots,T$ ， T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率 (benchmark_T) 按下列公式计算：

$benchmark_T = [\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)] - 1$

其中， $T=2,3,4,\dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)$ 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



注：1. 上图截止日期为2011年6月30日。

2. 本基金合同于2011年1月30日生效，截止本报告末本基金基金合同生效未满一年。

3. 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 2011 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、富国天鼎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二十二只证券投资基金。

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		
李笑薇	本基金基金经理兼任公司总经理助理、另类投资部总经理、富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2011-01-30	-	9 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 12 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理，2011 年 1 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；兼任富国基金公司总经理助理、另类投资部总经理；具有中国基金从业资格，美国国籍。
王保合	本基金基金经理兼	2011-03-03	-	6 年	博士，曾任富国基金管理有限公司研究员；富国沪深

	任 上 证 综 指 交 易 型 开 放 式 指 数 证 券 投 资 基 金 基 金 经 理				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。
--	--	--	--	--	--

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 2011 年 3 月 3 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，增聘王保合先生担任本基金基金经理，与李笑薇女士共同管理本基金。

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上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接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》、《富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，严格执行交易系统内的公平交易程序，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

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。

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，本基金于 3 月底完成建仓，建仓期间由于市场快速上涨带来一定负的跟踪误差，但建仓完毕后，本基金根据基金契约规定紧密跟踪业绩比较基准，年化跟踪误差为 1.76%。与基准正向偏离 0.29%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.950 元，份额累计净值为 0.950 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 -5%，同期业绩比较基准收益率为 0.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2011 年上半年，宏观调控政策持续收紧，市场关注焦点主要集中在逐渐升高的通货膨胀率以及未来经济增长的不确定性，欧美主权债务危机使得外围经济复苏的不确定性有所增加。整个上半年市场处于震荡走势，上证综指下跌 1.64%。相对而言，估值较安全的大盘蓝筹和价值股下跌幅度较少。

展望 2011 年下半年，宏观政策面临进一步收紧的可能性，国内经济仍然存在着一定的下行压力，欧美主权债务危机可能引发新的国际金融风险。但鉴于目前市场点位已经体现了对下半年经济悲观的预期，市场继续下行的空间有限，部分低估值大盘蓝筹股已经具有了相当的安全边际。综合来看，下半年市场可能继续延续区间震荡走势。

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

2011 年上半年，本基金托管人在对富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年上半年，富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、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。

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上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2011 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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部
2011 年 8 月 25 日

§ 6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2011 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2011 年 06 月 30 日)
资产：	
银行存款	22,115,351.08
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	416,926,670.79
其中：股票投资	976,670.79
基金投资	415,950,000.00
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	1,364,590.26
应收利息	4,329.19
应收股利	2,622.90
应收申购款	58,734.91
递延所得税资产	-
其他资产	-

资产总计	440,472,299.13
负债和所有者权益	本期末 (2011年06月30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	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	713,072.98
应付管理人报酬	9,795.07
应付托管费	1,959.01
应付销售服务费	-
应付交易费用	515,223.59
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	192,685.92
负债合计	1,432,736.57
所有者权益：	
实收基金	462,078,808.94
未分配利润	-23,039,246.38
所有者权益合计	439,039,562.56
负债和所有者权益总计	440,472,299.13

注：报告截止日 2011 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.950 元，基金份额总额 462,078,808.94 份。

本基金合同生效日为 2011 年 1 月 30 日，2011 年半年度实际报告期间为 2011 年 1 月 30 日至 2011 年 6 月 30 日。截至报告日本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无上年度同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2011 年 01 月 30 日至 2011 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日)
一、收入	-14,664,197.83
1.利息收入	1,377,722.84

其中：存款利息收入	534,883.42
债券利息收入	3,513.95
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	839,325.47
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	15,985,815.81
其中：股票投资收益	15,261,407.08
基金投资收益	-432.98
债券投资收益	663,039.65
资产支持证券投资收益	-
衍生工具投资收益	-
股利收益	61,802.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-32,405,948.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	378,212.22
减：二、费用	1,763,120.13
1. 管理人报酬	688,809.26
2. 托管费	137,761.82
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	746,187.57
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	190,361.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-16,427,317.96
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-16,427,317.96

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2011年01月30日至2011年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2011年01月30日(基金合同生效日)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）	744,561,592.09	-	744,561,592.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-16,427,317.96	-16,427,317.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变	-282,482,783.15	-6,611,928.42	-289,094,711.57

动数(净值减少以“-”号填列)			
其中:1.基金申购款	13,841,995.50	-369,034.16	13,472,961.34
2.基金赎回款	-296,324,778.65	-6,242,894.26	-302,567,672.91
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)	462,078,808.94	-23,039,246.38	439,039,562.56

注:本基金合同生效日为2011年1月30日,2011年半年度实际报告期间为2011年1月30日至2011年6月30日。截至报告日本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无上年度同期对比数据。

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
_____ 基金管理公司负责人	_____ 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

富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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”)证监基金字[2010]1379号文《关于核准上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准,由富国基金管理有限公司作为发起人于2011年1月5日到2011年1月26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(2011)验字第60467606_B02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2011年1月30日正式生效。本基金为契约型上市开放式,存续期限不定。首次设立时募集确认不包括认购资金利息的净认购金额为744,459,456.57元,折合基金份额744,459,456.57份。基金合同生效日的基金份额总额为744,561,592.09份,其中认购资金利息折合102,135.52份基金份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司,注册登记人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。

本基金以目标ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象,其中投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为:95%×上证综合指数收益率+5%×银行活期存款税后利率。本基金标的指数变更的,业绩比较基准将随之变更并公告。

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、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而编制。

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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 30 日（基金合同生效日）起至 2011 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2011 年 1 月 30 日（基金合同生效日）起至 2011 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资、基金投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现

金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益；

卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获

得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用

估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应

由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率逐日计提；

(2) 本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率逐日计提；

(3) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于截至收益分配基准日基金可供分配利润的 5%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 收益分配方式

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

分红方式的设置与变更：具体规则在招募说明书中列示。

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84号文《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自2007年5月30日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的1‰调整为3‰；

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（2011年06月30日）
活期存款	22,115,351.08
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计	22,115,351.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2011年06月30日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	932,988.87	976,670.79	43,681.92
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	448,399,630.62	415,950,000.00	-32,449,630.62
其他	-	-	-
合计	449,332,619.49	416,926,670.79	-32,405,948.70

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：本基金本报告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（2011年06月30日）
应收活期存款利息	4,329.19
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	-
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	4,329.19

6.4.7.6 其他资产

注：本报告期末本基金无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2011年06月30日）
交易所市场应付交易费用	515,223.59
银行间市场应付交易费用	-
合计	515,223.59

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2011年06月30日）
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,687.44
预提信息披露费	167,379.36
预提审计费用	22,619.12
合计	192,685.92

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2011年01月30日（基金合同生效日）至2011年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日（2011年01月30日）	744,561,592.09	744,561,592.09
本期申购	13,841,995.50	13,841,995.50
本期赎回（以“-”号填列）	-296,324,778.65	-296,324,778.65
本期末	462,078,808.94	462,078,808.94

注：1. 本基金合同于2011年1月30日生效，基金合同生效日的基金份额总额为744,561,592.09份基金份额，其中认购资金利息折合102,135.52份基金份额。

2. 本基金自2011年3月28日起开始办理申购赎回和转换业务。

3. 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
基金合同生效日（2011年01月30日）	-	-	-
本期利润	15,978,630.74	-32,405,948.70	-16,427,317.96
本期基金份额交易产生的变动数	-4,383,133.84	-2,228,794.58	-6,611,928.42
其中：基金申购款	354,429.57	-723,463.73	-369,034.16
基金赎回款	-4,737,563.41	-1,505,330.85	-6,242,894.26

本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,595,496.90	-34,634,743.28	-23,039,246.38

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2011年01月30日（基金合同生效日）至2011年06月30日）
活期存款利息收入	483,889.31
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	50,758.64
其他	235.47
合计	534,883.42

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 (2011年01月30日（基金合同生效日）至2011年06月30日)
股票投资收益——买卖股票差价收入	367,476.85
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	14,893,930.23
合计	15,261,407.08

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 (2011年01月30日（基金合同生效日）至2011年06月30日)
卖出股票成交总额	90,831,515.39
减：卖出股票成本总额	90,464,038.54
买卖股票差价收入	367,476.85

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 (2011年01月30日（基金合同生效日）至2011年06月30日)
申购基金份额总额	514,141,000.00
减：现金支付申购款总额	10,039,347.76
减：申购股票成本总额	489,415,425.71
减：申购可收退补款	-207,703.70
申购差价收入	14,893,930.23

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日)
卖出/赎回基金成交总额	65,764,846.19
减:卖出/赎回基金成本总额	65,765,279.17
基金投资收益	-432.98

6.4.7.14 债券投资收益

单位:人民币元

项目	本期(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日)
卖出债券(、含债转股及债券到期兑付)成交总额	7,384,553.60
减:卖出债券(、含债转股及债券到期兑付)成本总额	6,718,000.00
减:应收利息总额	3,513.95
债券投资收益	663,039.65

6.4.7.15 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注:本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日)
股票投资产生的股利收益	61,802.06
基金投资产生的股利收益	-
合计	61,802.06

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日)
1.交易性金融资产	-32,405,948.70
股票投资	43,681.92
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-32,449,630.62
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
合计	-32,405,948.70

6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日)
----	--------------------------------------

基金赎回费收入	378,074.89
转换费收入	137.33
合计	378,212.22

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2011年01月30日（基金合同生效日）至2011年06月30日）
交易所市场交易费用	746,187.57
银行间市场交易费用	-
合计	746,187.57

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2011年01月30日（基金合同生效日）至2011年06月30日）
审计费用	22,619.12
信息披露费	167,379.36
银行汇划费用	363.00
合计	190,361.48

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

本期内本基金存在控制关系或其他重大利害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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
上证综指交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

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

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

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(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	688,809.26
其中：支付销售机构的客户维护费	442,001.83

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.50%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$

H为每日应支付的基金管理费

E为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日基金持有的上证综指ETF公允价值，金额为负时以零计。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	137,761.82

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$

H为每日应支付的基金托管费

E为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日基金持有的上证综指ETF公允价值，金额为负时以零计。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券(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 2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日
基金合同生效日(2011年01月30日)持有的基金份额	29,999,000.00

期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
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	29,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.49%

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。

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：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	22,115,351.08	483,889.31

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：本报告期内本基金未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 150,000,000 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 81.68%。

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（2011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：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
600021	上海电力	2011-05-31	筹划重大事项	5.76	2011-07-28	6.34	2,200	11,782.17	12,672.00	-
600369	西南证券	2011-03-01	筹划重大事项	11.87	2011-08-16	12.49	68,400	763,118.20	811,908.00	-
601998	中信银行	2011-06-29	配股发行	4.75	2011-07-07	4.59	3,780	21,559.76	17,955.00	-

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：本基金本期末无银行间市场正回购余额，没有因正回购而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无交易所市场正回购余额。

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同责任，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“期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券部分”的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，并按照合约规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（2011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	22,115,351.08	-	-	-	-	-	22,115,351.08
交易性金融资产	-	-	-	-	-	416,926,670.79	416,926,670.79
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,364,590.26	1,364,590.26
应收利息	-	-	-	-	-	4,329.19	4,329.19
应收股利	-	-	-	-	-	2,622.90	2,622.90
应收申购款	58,734.91	-	-	-	-	-	58,734.91
资产总计	22,174,085.99	-	-	-	-	418,298,213.14	440,472,299.13
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	713,072.98	713,072.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,795.07	9,795.07
应付托管费	-	-	-	-	-	1,959.01	1,959.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	515,223.59	515,223.59
其他负债	-	-	-	-	-	192,685.92	192,685.92
负债总计	-	-	-	-	-	1,432,736.57	1,432,736.57
利率敏感度缺口	22,174,085.99	-	-	-	-	416,865,476.57	439,039,562.56

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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（2011年06月30日）
	1. 基准点利率增加 0.1%	0.00
	1. 基准点利率减少 0.1%	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

本基金以目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；于本报告期末，本基金面临的整体市场价格风险列示如下（下表中其它项目金额为本基金投资目标 ETF 的基金资产余额）：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2011年06月30日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	976,670.79	0.22
交易性金融资产-债券投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	415,950,000.00	94.74
合计	416,926,670.79	94.96

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（2011年06月30日）
	1.业绩比较基准减少1%	-4,338,360.48
	2.业绩比较基准增加1%	4,338,360.48

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	976,670.79	0.22
	其中：股票	976,670.79	0.22
2	基金投资	415,950,000.00	94.43
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	22,115,351.08	5.02
7	其他各项资产	1,430,277.26	0.32
8	合计	440,472,299.13	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例
----	------	------	------	-----	------	-----------

						(%)
1	富国上证综指ETF	股票型	交易型开放式	富国基金管理有限公司	415,950,000.00	94.74

7.3 期末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	252.00	0.00
B	采掘业	23,131.34	0.01
C	制造业	46,616.40	0.01
C0	食品、饮料	2,071.70	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	687.95	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	200.16	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	9,020.18	0.00
C5	电子	171.60	0.00
C6	金属、非金属	10,980.76	0.00
C7	机械、设备、仪表	11,241.31	0.00
C8	医药、生物制品	12,242.74	0.00
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	25,687.44	0.01
E	建筑业	1,204.70	0.00
F	交通运输、仓储业	9,223.43	0.00
G	信息技术业	9,381.60	0.00
H	批发和零售贸易	5,421.56	0.00
I	金融、保险业	847,046.00	0.19
J	房地产业	1,951.86	0.00
K	社会服务业	702.79	0.00
L	传播与文化产业	485.82	0.00
M	综合类	5,565.85	0.00
	合计	976,670.79	0.22

7.4 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

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	占基金资产净值比例 (%)
1	600369	西南证券	68,400	811,908.00	0.18
2	601998	中信银行	3,780	17,955.00	0.00
3	600021	上海电力	2,200	12,672.00	0.00
4	600547	山东黄金	208	9,326.72	0.00

5	600688	S 上石化	897	7,938.45	0.00
6	600780	通宝能源	943	6,412.40	0.00
7	601857	中国石油	582	6,337.98	0.00
8	600115	东方航空	1,095	5,694.00	0.00
9	600690	青岛海尔	199	5,562.05	0.00
10	601607	上海医药	313	5,258.40	0.00
11	600518	康美药业	399	5,250.84	0.00
12	600886	国投电力	647	4,690.75	0.00
13	600832	东方明珠	548	4,247.00	0.00
14	600859	王府井	100	3,997.00	0.00
15	600733	S 前锋	211	3,909.83	0.00
16	600783	鲁信创投	150	3,804.00	0.00
17	600775	南京熊猫	522	3,794.94	0.00
18	600629	棱光实业	299	3,719.56	0.00
19	601288	农业银行	1,266	3,544.80	0.00
20	601988	中国银行	748	2,348.72	0.00
21	600028	中国石化	221	1,818.83	0.00
22	601088	中国神华	57	1,717.98	0.00
23	601628	中国人寿	73	1,368.75	0.00
24	600036	招商银行	92	1,197.84	0.00
25	601318	中国平安	19	917.13	0.00
26	600519	贵州茅台	4	850.52	0.00
27	601328	交通银行	151	836.54	0.00
28	600000	浦发银行	83	816.72	0.00
29	601166	兴业银行	51	687.48	0.00
30	600016	民生银行	117	670.41	0.00
31	601818	光大银行	192	643.20	0.00
32	600104	上海汽车	34	637.16	0.00
33	601939	建设银行	111	548.34	0.00
34	601601	中国太保	24	537.36	0.00
35	601766	中国南车	74	526.88	0.00
36	600031	三一重工	28	505.12	0.00
37	601169	北京银行	48	478.56	0.00
38	600585	海螺水泥	17	471.92	0.00
39	600188	兖州煤业	13	458.90	0.00
40	600030	中信证券	34	444.72	0.00
41	600111	包钢稀土	6	428.58	0.00
42	600015	华夏银行	39	423.93	0.00
43	601989	中国重工	28	386.12	0.00
44	601898	中煤能源	38	380.00	0.00
45	601600	中国铝业	33	363.33	0.00

46	601899	紫金矿业	50	362.00	0.00
47	600900	长江电力	50	360.50	0.00
48	601111	中国国航	37	354.83	0.00
49	601009	南京银行	37	331.89	0.00
50	601008	连云港	33	330.00	0.00
51	600020	中原高速	99	328.68	0.00
52	601699	潞安环能	10	328.10	0.00
53	601668	中国建筑	80	322.40	0.00
54	601006	大秦铁路	39	319.41	0.00
55	600362	江西铜业	9	318.96	0.00
56	600348	阳泉煤业	13	313.82	0.00
57	601377	兴业证券	18	310.14	0.00
58	600050	中国联通	59	309.75	0.00
59	600019	宝钢股份	50	301.50	0.00
60	601958	金铝股份	15	288.75	0.00
61	601688	华泰证券	23	284.05	0.00
62	600809	山西汾酒	4	280.20	0.00
63	600048	保利地产	25	274.75	0.00
64	600489	中金黄金	10	272.90	0.00
65	600724	宁波富达	30	269.70	0.00
66	600395	盘江股份	8	265.52	0.00
67	601727	上海电气	38	262.96	0.00
68	600256	广汇股份	11	261.58	0.00
69	600999	招商证券	14	257.32	0.00
70	600598	北大荒	18	252.00	0.00
71	600535	天士力	6	246.78	0.00
72	600652	爱使股份	32	246.40	0.00
73	600029	南方航空	31	243.04	0.00
74	600804	鹏博士	30	236.70	0.00
75	601788	光大证券	17	233.75	0.00
76	601018	宁波港	72	230.40	0.00
77	601117	中国化学	26	230.36	0.00
78	600132	重庆啤酒	4	229.60	0.00
79	601678	滨化股份	13	229.45	0.00
80	600309	烟台万华	12	224.52	0.00
81	601666	平煤股份	16	224.16	0.00
82	600697	欧亚集团	8	222.40	0.00
83	601618	中国中冶	56	220.64	0.00
84	600648	外高桥	16	219.04	0.00
85	600406	国电南瑞	6	217.80	0.00
86	600236	桂冠电力	39	215.67	0.00

87	601808	中海油服	12	214.32	0.00
88	600143	金发科技	13	213.98	0.00
89	600085	同仁堂	6	213.96	0.00
90	600018	上港集团	54	210.60	0.00
91	600665	天地源	41	209.92	0.00
92	600276	恒瑞医药	7	209.79	0.00
93	600549	厦门钨业	5	207.15	0.00
94	600089	特变电工	16	207.04	0.00
95	600271	航天信息	8	206.72	0.00
96	600208	新湖中宝	33	205.59	0.00
97	600377	宁沪高速	38	205.58	0.00
98	600600	青岛啤酒	6	204.84	0.00
99	601801	皖新传媒	14	203.98	0.00
100	601299	中国北车	30	201.00	0.00
101	600103	青山纸业	48	200.16	0.00
102	600887	伊利股份	12	199.80	0.00
103	600062	双鹤药业	8	198.32	0.00
104	600126	杭钢股份	37	198.32	0.00
105	600510	黑牡丹	20	195.60	0.00
106	600011	华能国际	37	195.36	0.00
107	600626	申达股份	38	194.18	0.00
108	601186	中国铁建	32	193.60	0.00
109	600316	洪都航空	6	193.38	0.00
110	601005	重庆钢铁	46	191.82	0.00
111	600007	中国国贸	21	190.68	0.00
112	600270	外运发展	23	190.67	0.00
113	601588	北辰实业	52	190.32	0.00
114	600795	国电电力	64	189.44	0.00
115	600770	综艺股份	10	189.20	0.00
116	601390	中国中铁	47	187.53	0.00
117	601001	大同煤业	11	187.00	0.00
118	600277	亿利能源	13	186.16	0.00
119	600027	华电国际	56	185.92	0.00
120	601919	中国远洋	22	182.38	0.00
121	601158	重庆水务	22	181.72	0.00
122	600569	安阳钢铁	49	181.30	0.00
123	600875	东方电气	7	178.50	0.00
124	600741	华域汽车	16	178.08	0.00
125	600871	S 仪化	19	178.03	0.00
126	600398	凯诺科技	33	177.87	0.00
127	601168	西部矿业	12	177.84	0.00

128	600861	北京城乡	18	175.86	0.00
129	600307	酒钢宏兴	32	175.36	0.00
130	601268	二重重装	16	173.44	0.00
131	601877	正泰电器	10	173.30	0.00
132	600171	上海贝岭	24	171.60	0.00
133	600058	五矿发展	5	171.40	0.00
134	600221	海南航空	24	171.36	0.00
135	600987	航民股份	23	169.74	0.00
136	600282	南钢股份	42	168.42	0.00
137	600100	同方股份	16	167.36	0.00
138	600606	金丰投资	26	167.18	0.00
139	600787	中储股份	16	167.04	0.00
140	600739	辽宁成大	6	166.80	0.00
141	600660	福耀玻璃	16	165.76	0.00
142	601888	中国国旅	7	165.41	0.00
143	600588	用友软件	8	165.28	0.00
144	600166	福田汽车	19	164.92	0.00
145	600737	中粮屯河	16	164.00	0.00
146	600655	豫园商城	15	163.20	0.00
147	600066	宇通客车	7	161.98	0.00
148	600350	山东高速	39	161.46	0.00
149	600812	华北制药	14	161.28	0.00
150	600673	东阳光铝	10	160.10	0.00
151	600109	国金证券	11	160.05	0.00
152	600415	小商品城	13	159.77	0.00
153	600320	振华重工	24	159.60	0.00
154	601918	国投新集	13	158.08	0.00
155	601991	大唐发电	28	156.24	0.00
156	600798	宁波海运	34	156.06	0.00
157	600546	山煤国际	5	155.95	0.00
158	600893	航空动力	9	155.61	0.00
159	600497	驰宏锌锗	7	154.35	0.00
160	600663	陆家嘴	11	153.78	0.00
161	600694	大商股份	4	152.92	0.00
162	601098	中南传媒	16	152.48	0.00
163	601718	际华集团	33	151.80	0.00
164	600619	海立股份	13	151.19	0.00
165	600176	中国玻纤	5	151.10	0.00
166	601777	力帆股份	14	150.08	0.00
167	600150	中国船舶	2	147.98	0.00
168	600061	中纺投资	14	147.84	0.00

169	600575	芜湖港	16	146.88	0.00
170	600750	江中药业	6	146.88	0.00
171	600653	申华控股	43	146.63	0.00
172	600508	上海能源	6	146.22	0.00
173	600220	江苏阳光	29	146.16	0.00
174	600006	东风汽车	33	144.54	0.00
175	600068	葛洲坝	12	143.88	0.00
176	600597	光明乳业	18	142.74	0.00
177	601369	陕鼓动力	13	142.61	0.00
178	600760	中航黑豹	11	141.57	0.00
179	600196	复星医药	13	141.44	0.00
180	601099	太平洋	15	141.30	0.00
181	600664	哈药股份	9	141.30	0.00
182	601106	中国一重	29	140.65	0.00
183	601179	中国西电	23	140.30	0.00
184	600380	健康元	15	138.15	0.00
185	600970	中材国际	5	136.65	0.00
186	600998	九州通	11	135.85	0.00
187	600161	天坛生物	8	135.60	0.00
188	600432	吉恩镍业	6	133.68	0.00
189	600703	三安光电	8	131.20	0.00
190	601866	中海集运	36	131.04	0.00
191	600498	烽火通信	5	129.90	0.00
192	600551	时代出版	11	129.36	0.00
193	600674	川投能源	9	129.06	0.00
194	600682	南京新百	12	126.24	0.00
195	600550	天威保变	7	126.07	0.00
196	600718	东软集团	11	125.18	0.00
197	600601	方正科技	33	118.14	0.00
198	600054	黄山旅游	7	116.34	0.00
199	600500	中化国际	11	109.89	0.00
200	601717	郑煤机	3	109.38	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601857	中国石油	51,206,341.61	11.66
2	601288	农业银行	22,938,732.04	5.22
3	601988	中国银行	19,558,701.00	4.45

4	600028	中国石化	14,820,440.77	3.38
5	601628	中国人寿	12,346,966.01	2.81
6	601088	中国神华	12,282,004.17	2.80
7	600036	招商银行	8,773,908.76	2.00
8	601318	中国平安	7,459,626.51	1.70
9	600000	浦发银行	6,860,957.51	1.56
10	601328	交通银行	6,741,767.00	1.54
11	600519	贵州茅台	6,159,397.35	1.40
12	601166	兴业银行	5,962,564.03	1.36
13	601818	光大银行	5,912,922.00	1.35
14	601998	中信银行	5,853,584.40	1.33
15	600016	民生银行	4,993,207.00	1.14
16	601169	北京银行	4,174,959.77	0.95
17	601601	中国太保	4,102,094.67	0.93
18	601939	建设银行	4,016,380.00	0.91
19	600030	中信证券	3,988,636.14	0.91
20	600031	三一重工	3,646,475.70	0.83

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601857	中国石油	8,347,383.76	1.90
2	601288	农业银行	3,939,377.53	0.90
3	601988	中国银行	3,217,945.19	0.73
4	600028	中国石化	2,394,313.99	0.55
5	601088	中国神华	2,233,258.35	0.51
6	601628	中国人寿	1,999,608.24	0.46
7	600036	招商银行	1,510,814.00	0.34
8	601989	中国重工	1,443,784.30	0.33
9	601318	中国平安	1,370,598.81	0.31
10	600000	浦发银行	1,192,319.22	0.27
11	601328	交通银行	1,139,172.27	0.26
12	601166	兴业银行	1,020,807.38	0.23
13	601818	光大银行	947,682.63	0.22
14	601998	中信银行	936,864.92	0.21
15	600519	贵州茅台	921,222.79	0.21
16	600016	民生银行	900,571.41	0.21
17	600550	天威保变	732,899.65	0.17
18	600104	上海汽车	729,242.48	0.17
19	601601	中国太保	697,422.23	0.16

20	601169	北京银行	688,169.59	0.16
----	--------	------	------------	------

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 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	515,358,005.12
卖出股票收入（成交）总额	90,831,515.39

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

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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	应收证券清算款	1,364,590.26
3	应收股利	2,622.90
4	应收利息	4,329.19
5	应收申购款	58,734.91
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,430,277.26

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600369	西南证券	811,908.00	0.18	筹划重大事项
2	601998	中信银行	17,955.00	0.00	配股发行
3	600021	上海电力	12,672.00	0.00	筹划重大事项

7.10.6 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。

§ 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(%)
6884	67,123.59	65,448,349.60	14.16	396,630,459.34	85.84

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	40,500.10	0.0088

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年01月30日)基金份额总额	744,561,592.09
本报告期(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日)基金总申购份额	13,841,995.50
减:本报告期(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日)基金总赎回份额	296,324,778.65
本报告期(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年06月30日)基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	462,078,808.94

§ 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

本报告期内本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 (%)	
银河证券	2	606,144,172.39	100.00	7,384,553.60	100.00	5,414,800,000.00	100.00	-	-	515,223.59	100.00	-

注：我对基金交易席位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；上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金；本基金合同于 2011 年 1 月 30 日成立，上表所列交易单元均为本报告期新增。

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	富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2011年01月31日
2	富国基金管理有限公司关于增聘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的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2011年03月03日
3	富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金开放申购、赎回业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2011年03月23日
4	富国基金管理有限公司关于旗下基金持有的双汇发展股票估值方法调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2011年03月22日
5	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金持有的中百集团股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2011年05月31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上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件 2、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合同 3、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议 4、中国证监会批准设立	上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5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： http://www.fullgoal.com.cn

<p>富国基金管理有限公司的文件</p> <p>5、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金财务报表及报表附注</p> <p>6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告</p>		
--	--	--