

上证综指交易型开放式指数证券投资基金  
二〇一三年年度报告

2013年12月31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： 2014年03月29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。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 27 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。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 2013 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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	13
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.....	13
§6	审计报告.....	14
§7	年度财务报表.....	15
7.1	资产负债表.....	15
7.2	利润表.....	16
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4	报表附注.....	18
§8	投资组合报告.....	37
8.1	期末基金资产组合情况.....	37
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	38
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
8.6	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.....	45
8.7	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.....	45
8.8	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.....	45

8.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	45
8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
8.11	投资组合报告附注 .....	46
§9	基金份额持有人信息 .....	47
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	47
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
§10	开放式基金份额变动 .....	48
§11	重大事件揭示 .....	48
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	48
11.2	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 .....	48
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
11.4	基金投资策略的改变 .....	48
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	48
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
11.8	其他重大事件 .....	50
§12	备查文件目录 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 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
基金简称	上证综指 ETF
基金主代码	510210
交易代码	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	123,638,513.00 份
基金合同存续期	不定期
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 3 月 25 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数（上证综合指数），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，从而实现对标的指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	上证综合指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，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。

### 2.3 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	范伟隽	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 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	楼	
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楼 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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年01月30日 (基金合同生效日) 至2011年12月31日
本期已实现收益	-20,422,225.96	-39,482,236.02	-5,594,456.66
本期利润	-12,857,686.70	21,425,703.25	-129,285,731.20
加权平均基金份额本期利润	-0.0923	0.1188	-0.7737
本期加权平均净值利润率	-4.02%	5.24%	-29.09%
本期基金份额净值增长率	-3.73%	6.03%	-23.92%
3.1.2 期末数据和指标	2013年12月31日	2012年12月31日	2011年12月31日
期末可供分配利润	-80,773,357.31	-86,220,069.99	-127,653,772.31
期末可供分配基金份额利润	-0.6533	-0.5649	-0.6989
期末基金资产净值	280,498,008.11	359,789,208.77	406,015,416.54

期末基金份额净值	2.269	2.357	2.223
3.1.3 累计期末指标	2013年12月31日	2012年12月31日	2011年12月31日
基金份额累计净值增长率	-22.35%	-19.34%	-23.92%

注：1. 本基金已于 2011 年 3 月 11 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.34223209。

2. 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。

3. 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。

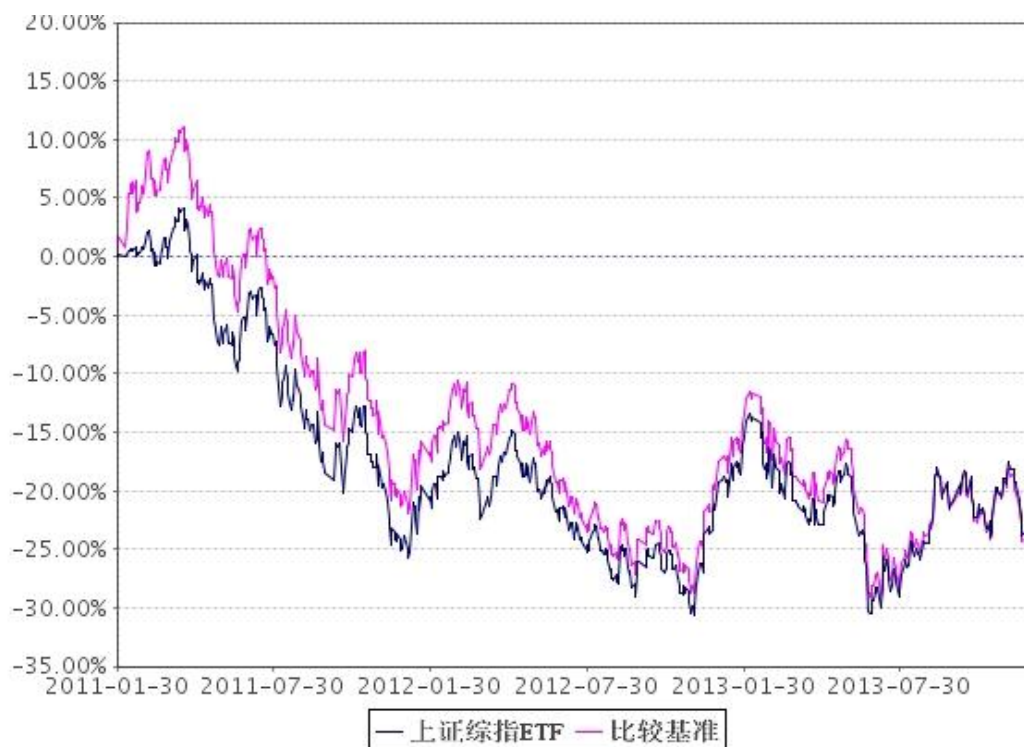
4. 本基金合同于 2011 年 1 月 30 日生效，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

### 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	-1.94%	1.02%	-2.70%	0.98%	0.76%	0.04%
过去六个月	9.88%	1.12%	6.91%	1.07%	2.97%	0.05%
过去一年	-3.73%	1.19%	-6.75%	1.15%	3.02%	0.04%
自基金合同生效日起至今	-22.35%	1.12%	-23.13%	1.12%	0.78%	0.00%

### 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：截止日期为 2012 年 12 月 31 日。

本基金合同于 2011 年 1 月 30 日生效。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。



### 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



注：本基金于 2011 年 1 月 30 日成立，2011 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

注：本基金自基金合同生效日（2011 年 1 月 30 日）至本报告期末未发生利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理

#### 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。截至 2013 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（LOF）、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、富国汇利回报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、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国信用增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业股票型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金四十二只证券投资基金。

#### 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		
王保合	本基金基金经理兼任量化投资副总监、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、富国创业板指数分级证券投资基金基金经理	2011-03-03	—	8 年	博士，曾任富国基金管理有限公司研究员；富国沪深 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，2013 年 9 月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理；兼任量化投资副总监；具有基金从业资格，中国国籍。

注：上述表格内基金经理的任职日期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上证综指交易型开放式指数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》、《上证综指交易型开放式指数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t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

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行指数增强和风险管理，虽然报告期内市场较大波动，本基金的跟踪误差一直保持较低水平，年化跟踪误差只有 1.55%。

回顾 2013 年，整体经济增长稳中趋弱的震荡走势，一二季度经济有所回落，在经历了第三季度的显著反弹后，部分经济指标在四季度显示出经济增长放缓的态势。随着十八届三中全会的召开，未来中国经济改革的坚定性得到了进一步地确认。投资者普遍担心经济改革初期会对经济增长造成一定负面影响。IPO 重新开闸的消息也对市场情绪造成冲击，开闸之后的资金分流和未来可能的估值中枢下移都将给市场带来负面影响。2013 年整体资本市场同样呈现了震荡走势，整年上证综指指数下跌 6.75%。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.269 元，份额累计净值为 0.777 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-3.73%，同期业绩比较基准收益率为-6.75%。

## 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 2014 年，中国经济改革将在 2014 加速推进，产业结构调整、财税体制改革、对外经济开放、国企改革、新兴城镇化和金融改革六个领域将成为改革的重点方向。货币信贷政策仍将稳中偏紧，投资者需要密切关注地方政府融资平台和影子银行监管等事件性风险。预计 2014 年整体将呈现先抑后扬走势，改革业绩的逐渐兑现将使得投资者对于经济的信心有系统性的回升。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

本基金管理人一贯坚持“风险管理是公司发展的生命线”的理念，并把维护持有人利益作为己任。在监察稽核基础性工作基础上，2013 年本基金管理人着重开展了如下与监察稽核有关的工作：

### 1、着力推进制度建设，加强制度的可操作性

根据法律法规的要求，监察稽核部结合公司运作情况，协同业务部门对现有制度和流程进行了持续修订和完善。如：修订了《富国基金管理有限公司固有资金投资管理办法》，以更切合公司对固有资金管理的需要；草拟了《富国基金管理有限公司董事、监事及员工证券交易行为管理暂行办法》，以更有效地管理从业人员的证券交易行为。

### 2、提高风控的主动性，提升投资风控的效率

在“事前防范为主、事中监控为辅、事后稽核为补”工作原则的指导下，监察稽核部主动梳理了投资组合的合规指标、规范了交易系统权限设置、完善了场内外交易对手库管理。此外，主动推进股指期货风控模块的改进，为确保新系统平稳有效运行，在系统风控相关模块有效性测试的基础上，还开展了后续跟踪评估，以减少新系统可能带来的不兼容风险。

### 3、积极开展合规培训，提升全员业务合规意识

为提高业务部门一线风控水平，在各业务部门自学法律法规的基础上，监察稽核部门还邀请外部律师开展专题讲座培训，结合工作实际的培训内容，以深入浅出

的培训内容和形式，及时、有效地传达最新的法律法规，既提升了员工的风险合规意识，又使公司及业务的内部控制和风险管理得到夯实和优化。

#### 4、全面加强合规管理，深化业务开展的合规性

立足于“及时掌握监管动态，熟练知晓法律要求、全面提高服务水平”，监察稽核部通过主动与业务部门沟通，切实履行合规的建言、建议权，从源头上保障业务开展的合规性，通过配合做好召开持有人大会等合规外延性工作，最大限度地发挥合规管理工作的协同效应。此外，结合常规的季度监察稽核工作，有针对性地开展了六次专项审计，严格规范基金运作和公司经营所涉及的业务流程。

### 4.7 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。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，2013年报告期末本基金未满足收益分配条件，故不进行收益分配。

## §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

本报告期内，本基金托管人在对上证综指交易型开放式指数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

本报告期内，上证综指交易型开放式指数证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在上证综指交易型开放式指数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，上证综指交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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上证综指交易型开放式指数证券投资基金2013年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。

中国工商银行资产托管部  
2014年3月27日

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	上证综指交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的上证综指交易型开放式指数证券投资基金财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表和 2013 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人富国基金管理有限公司的责任。这种责任包括： （1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了上证综指交易型开放式指数证券投资基金 2013

	年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	徐 艳	黎 燕
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼	
审计报告日期	2014 年 03 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2013 年 12 月 31 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)
<b>资 产：</b>		
银行存款	1,207,981.59	2,985,413.35
结算备付金	342.59	20.21
存出保证金	3,968.05	—
交易性金融资产	279,671,071.84	357,274,159.20
其中：股票投资	278,950,411.64	357,274,159.20
基金投资	—	—
债券投资	720,660.20	—
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	—	31,979.50
应收利息	840.47	656.48
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	280,884,204.54	360,292,228.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2013 年 12 月 31 日)</b>	<b>上年度末 (2012 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	—	134.72
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	121,830.36	158,398.40
应付托管费	24,366.07	31,679.70
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	—	436.65
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	240,000.00	312,370.50
负债合计	386,196.43	503,019.97
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	361,271,365.42	446,009,278.76
未分配利润	-80,773,357.31	-86,220,069.99
所有者权益合计	280,498,008.11	359,789,208.77
负债和所有者权益总计	280,884,204.54	360,292,228.74

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.269 元，基金份额总额 123,638,513.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2013 年 01 月 01 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2013 年 01 月 01 日至 2013 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2012 年 01 月 01 日至 2012 年 12 月 31 日)
<b>一、收入</b>	-10,260,866.14	24,569,572.97
1. 利息收入	18,508.85	22,231.57
其中：存款利息收入	17,936.34	22,093.58
债券利息收入	572.51	137.99
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）	-17,874,700.18	-36,359,554.87
其中：股票投资收益	-26,350,416.34	-45,595,536.41
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	49,504.91
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	8,475,716.16	9,186,476.63



3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,564,539.26	60,907,939.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	30,785.93	-1,043.00
<b>减：二、费用</b>	<b>2,596,820.56</b>	<b>3,143,869.72</b>
1. 管理人报酬	1,605,957.37	2,046,745.20
2. 托管费	321,191.55	409,348.98
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	149,219.14	167,310.54
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	520,452.50	520,465.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-12,857,686.70</b>	<b>21,425,703.25</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-12,857,686.70</b>	<b>21,425,703.25</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2013年01月01日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2013年01月01日至2013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）	446,009,278.76	-86,220,069.99	359,789,208.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-12,857,686.70	-12,857,686.70
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）	-84,737,913.34	18,304,399.38	-66,433,513.96
其中：1. 基金申购款	33,602,965.63	-7,039,731.18	26,563,234.45
2. 基金赎回款	-118,340,878.97	25,344,130.56	-92,996,748.41
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）	361,271,365.42	-80,773,357.31	280,498,008.11
项目	上年度可比期间 (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）	533,669,188.85	-127,653,772.31	406,015,416.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	21,425,703.25	21,425,703.25

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）	-87,659,910.09	20,007,999.07	-67,651,911.02
其中：1. 基金申购款	62,822,935.71	-14,236,429.22	48,586,506.49
2. 基金赎回款	-150,482,845.80	34,244,428.29	-116,238,417.51
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）	446,009,278.76	-86,220,069.99	359,789,208.77

注：所附附注为本会计报表的组成部分

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：

陈 戈	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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

上证综指交易型开放式指数证券投资基金（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[2010]1379号《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管理人向社会公开募集，基金合同于2011年1月30日正式生效，首次设立募集规模为320,363,407.00份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%。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%。

本基金业绩比较基准为标的指数。

### 7.4.2 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，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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2号《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。

#### **7.4.3 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 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

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。

##### **7.4.4.1 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。

##### **7.4.4.2 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。

##### **7.4.4.3 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。

##### **7.4.4.4 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；

投资者申购本基金时交付的股票于申购日计入股票投资，股票投资成本以申购日该股票收盘价确认的价值入账；

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；

投资者赎回本基金时交付的股票于赎回日确认股票差价收入，交付的股票的成本于赎回日采用加权平均法结转；

#### (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。

### 7.4.4.5 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。

#### **7.4.4.6 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。

#### **7.4.4.7 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。

#### **7.4.4.8 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)”。

#### **7.4.4.9 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,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。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.5%的年费率逐日计提;
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率逐日计提;
- (3) 卖出回购金融资产支出,按卖出回购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;
- (4) 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。

#### **7.4.4.11 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 12 次,每次收益分配比例依据以下原则确定:使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率;
- (2) 本基金收益分配采用现金方式;
- (3) 当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时,可进行收益分配;
- (4) 基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值,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可能低于面值;
- (5) 每一基金份额享有同等分配权;
- (6) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]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；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。



## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
活期存款	1,207,981.59	2,985,413.35
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	1,207,981.59	2,985,413.35

注：本基金本报告期内及上年度可比期内均未投资于定期存款。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	334,199,867.85	278,950,411.64	-55,249,456.21
债券	交易所市场	690,000.00	720,660.20
	银行间市场	—	—
	合计	690,000.00	720,660.20
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	334,889,867.85	279,671,071.84	-55,218,796.01
项目	上年度末（2012年12月31日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	420,057,494.47	357,274,159.20	-62,783,335.27
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	420,057,494.47	357,274,159.20	-62,783,335.27

注：股票投资的公允价值及股票投资的公允价值变动含可退替代款的估值增值。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末及上年度末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
应收活期存款利息	265.76	656.48
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	0.22	—
应收债券利息	572.51	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
其他	1.98	—
合计	840.47	656.48

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
交易所市场应付交易费用	—	436.65
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	—	436.65

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	—	—
预提审计费	50,000.00	50,000.00
预提信息披露费	140,000.00	210,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
可退替代款	—	2,370.50
合计	240,000.00	312,370.50

注：（1）应付替代款是指投资者采用可以用现金替代方式申购本基金时，在基金补足被替代股票（或采取强制退款）之后，以该股票的替代金额与买入成本的差额确定应退还给投资者或应由投资者补缴的现金替代款；

（2）可退替代款是指投资者采用可以用现金替代方式申购本基金时，在基金补足被替代股票（或采取强制退款）之前，该股票的实际替代金额与申购日估值的差额。

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	152,638,513.00	446,009,278.76

本期申购	11,500,000.00	33,602,965.63
本期赎回（以“-”号填列）	-40,500,000.00	-118,340,878.97
本期末	123,638,513.00	361,271,365.42

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	-39,989,557.95	-46,230,512.04	-86,220,069.99
本期利润	-20,422,225.96	7,564,539.26	-12,857,686.70
本期基金份额交易产生的变动数	9,807,340.52	8,497,058.86	18,304,399.38
其中：基金申购款	-3,808,067.76	-3,231,663.42	-7,039,731.18
基金赎回款	13,615,408.28	11,728,722.28	25,344,130.56
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-50,604,443.39	-30,168,913.92	-80,773,357.31

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
活期存款利息收入	17,052.26	21,252.33
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	825.47	841.25
其他	58.61	—
合计	17,936.34	22,093.58

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,891,961.60	-18,569,485.79
股票投资收益——赎回差价收入	-17,458,454.74	-27,026,050.62
股票投资收益——申购差价收入	—	—
合计	-26,350,416.34	-45,595,536.41

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
卖出股票成交总额	46,245,057.28	52,820,505.58
减：卖出股票成本总额	55,137,018.88	71,389,991.37

买卖股票差价收入	-8,891,961.60	-18,569,485.79
----------	---------------	----------------

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
赎回基金份额对价总额	92,996,748.41	116,238,417.51
减：现金支付赎回款总额	1,124,027.41	308,842.51
减：赎回股票成本总额	109,331,175.74	142,955,625.62
赎回差价收入	-17,458,454.74	-27,026,050.62

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
卖出债券(、含债转股及债券到期兑付)成交总额	—	840,642.90
减：卖出债券(、含债转股及债券到期兑付)成本总额	—	791,000.00
减：应收利息总额	—	137.99
债券投资收益	—	49,504.91

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无权证投资收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
股票投资产生的股利收益	8,475,716.16	9,186,476.63
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	8,475,716.16	9,186,476.63

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
1. 交易性金融资产	7,564,539.26	60,907,939.27
股票投资	7,533,879.06	60,907,939.27
债券投资	30,660.20	—
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	7,564,539.26	60,907,939.27

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
基金赎回费收入	—	—
替代损益	28,598.02	-1,043.00
其他	2,187.91	—
合计	30,785.93	-1,043.00

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
交易所市场交易费用	149,219.14	167,310.54
银行间市场交易费用	—	—
合计	149,219.14	167,310.54

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	210,000.00	210,000.00
银行费用	452.50	465.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
合计	520,452.50	520,465.00

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 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、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
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
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“富国上证ETF联接”）	本基金的联接基金

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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

#### 7.4.10.1.4 回购交易

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回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均没有应支付的关联方佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	1,605,957.37	2,046,745.20
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

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 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至 2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01 月01日至2012年12月31日)
当期发生的基金应支付的 托管费	321,191.55	409,348.98

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 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

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。

##### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末(2013年12月31日)		上期末(2012年12月31日)	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例(%)
富国上证综指交易 型开放式指数证券 投资基金联接基金	109,621,447.00	88.66	135,621,447.00	88.85

注：于本报告期末，富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金持有的本基金份额均为一级市场申购的份额，其投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 7.4.10.5 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(2013年01月01日至2013年12月31 日)		上年度可比期间(2012年01月01日至2012 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
中国工商银行股份有限 公司	1,207,981.59	17,052.26	2,985,413.35	21,252.33

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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
600547	山东黄金	2013-12-26	筹划重大事项	17.25	2014-01-02	17.52	37,701	1,615,986.24	650,342.25	—
601901	方正证券	2013-08-26	筹划重大事项	5.91	2014-01-13	6.24	219,100	1,017,742.23	1,294,881.00	—

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2013年12月31日，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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日，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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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。本基金投资于一家上市公司发行的股票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上市公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，但标的指数成份股不受此限。

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。

#### **7.4.13.3 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开放式：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 7.4.12 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。

#### **7.4.13.4 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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **7.4.13.4.1 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、存出保证金及债券投资等。

###### **7.4.13.4.1.1 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（2013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	1,207,981.59	—	—	—	—	—	1,207,981.59
结算备付金	342.59	—	—	—	—	—	342.59
存出保证金	3,968.05	—	—	—	—	—	3,968.05
交易性金融资产	—	—	720,660.20	—	—	278,950,411.64	279,671,071.84
应收利息	—	—	—	—	—	840.47	840.47
资产总计	1,212,292.23	—	720,660.20	—	—	278,951,252.11	280,884,204.54
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	121,830.36	121,830.36
应付托管费	—	—	—	—	—	24,366.07	24,366.07
其他负债	—	—	—	—	—	240,000.00	240,000.00
负债总计	—	—	—	—	—	386,196.43	386,196.43
利率敏感度缺口	1,212,292.23	—	720,660.20	—	—	278,565,055.68	280,498,008.11
上年度末（2012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	2,985,413.35	—	—	—	—	—	2,985,413.35
结算备付金	20.21	—	—	—	—	—	20.21
交易性金融资产	—	—	—	—	—	357,274,159.20	357,274,159.20
应收证券清算款	—	—	—	—	—	31,979.50	31,979.50
应收利息	—	—	—	—	—	656.48	656.48

资产总计	2,985,433.56	—	—	—	—	357,306,795.18	360,292,228.74
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	134.72	134.72
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	158,398.40	158,398.40
应付托管费	—	—	—	—	—	31,679.70	31,679.70
应付交易费用	—	—	—	—	—	436.65	436.65
其他负债	—	—	—	—	—	312,370.50	312,370.50
负债总计	—	—	—	—	—	503,019.97	503,019.97
利率敏感度缺口	2,985,433.56	—	—	—	—	356,803,775.21	359,789,208.77

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券(不含可转债)，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(2013年12月31日)	上年度末(2012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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资组合中投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。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%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末(2013年12月31日)		上年度末(2012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	278,950,411.64	99.45	357,274,159.20	99.30
交易性金融资产—债券投资	720,660.20	0.26	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—

合计	279,671,071.84	99.71	357,274,159.20	99.30
----	----------------	-------	----------------	-------

#### 7.4.13.4.3.2 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（2013年12月 31日）	上年度末（2012年12月 31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	2,883,057.52	3,599,607.61
	2. 业绩比较基准减少1%	-2,883,057.52	-3,599,607.61

**7.4.14 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	278,950,411.64	99.31
	其中：股票	278,950,411.64	99.31
2	固定收益投资	720,660.20	0.26
	其中：债券	720,660.20	0.26
	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	1,208,324.18	0.43
6	其他各项资产	4,808.52	0.00

7	合计	280,884,204.54	100.00
---	----	----------------	--------

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合：

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 8.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,150,780.00	1.12
B	采矿业	45,784,560.38	16.32
C	制造业	79,409,973.48	28.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,895,700.72	3.53
E	建筑业	8,022,780.76	2.86
F	批发和零售业	9,214,585.50	3.29
G	交通运输、仓储和邮政业	12,594,983.00	4.49
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,098,937.70	2.17
J	金融业	87,061,939.99	31.04
K	房地产业	7,972,676.75	2.84
L	租赁和商务服务业	1,563,431.00	0.56
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	1,872,669.26	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	3,746,249.00	1.34
S	综合	2,561,144.10	0.91
	合计	278,950,411.64	99.45

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 8.3.1 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	601857	中国石油	2,966,000	22,867,860.00	8.15
2	601288	农业银行	6,019,700	14,928,856.00	5.32
3	601988	中国银行	4,240,400	11,109,848.00	3.96
4	600028	中国石化	1,624,388	7,277,258.24	2.59
5	601628	中国人寿	384,400	5,815,972.00	2.07
6	600036	招商银行	414,391	4,512,717.99	1.61
7	601088	中国神华	281,300	4,450,166.00	1.59

8	600000	浦发银行	465,040	4,385,327.20	1.56
9	601166	兴业银行	428,670	4,346,713.80	1.55
10	601328	交通银行	1,035,920	3,977,932.80	1.42
11	600016	民生银行	510,900	3,944,148.00	1.41
12	601318	中国平安	87,200	3,638,856.00	1.30
13	601998	中信银行	903,460	3,496,390.20	1.25
14	601818	光大银行	1,264,500	3,363,570.00	1.20
15	600015	华夏银行	361,530	3,098,312.10	1.10
16	600104	上汽集团	196,600	2,779,924.00	0.99
17	600519	贵州茅台	18,990	2,437,936.20	0.87
18	600626	申达股份	259,550	2,322,972.50	0.83
19	601169	北京银行	308,440	2,316,384.40	0.83
20	600030	中信证券	180,600	2,302,650.00	0.82
21	601601	中国太保	112,200	2,079,066.00	0.74
22	601939	建设银行	494,800	2,048,472.00	0.73
23	600018	上港集团	380,700	2,010,096.00	0.72
24	601989	中国重工	341,460	1,915,590.60	0.68
25	601009	南京银行	232,000	1,876,880.00	0.67
26	600398	凯诺科技	265,000	1,876,200.00	0.67
27	601633	长城汽车	45,000	1,852,650.00	0.66
28	600887	伊利股份	45,900	1,793,772.00	0.64
29	600900	长江电力	277,500	1,753,800.00	0.63
30	601006	大秦铁路	235,600	1,741,084.00	0.62
31	601668	中国建筑	524,300	1,646,302.00	0.59
32	600276	恒瑞医药	37,670	1,430,706.60	0.51
33	601808	中海油服	63,100	1,408,392.00	0.50
34	600999	招商证券	110,450	1,400,506.00	0.50
35	600587	新华医疗	19,817	1,385,406.47	0.49
36	601118	海南橡胶	186,200	1,383,466.00	0.49
37	600585	海螺水泥	81,450	1,381,392.00	0.49
38	601766	中国南车	265,964	1,332,479.64	0.48
39	601515	东风股份	51,400	1,326,634.00	0.47
40	601299	中国北车	268,890	1,322,938.80	0.47
41	601901	方正证券	219,100	1,294,881.00	0.46
42	600309	万华化学	61,341	1,269,758.70	0.45
43	600663	陆家嘴	74,400	1,264,056.00	0.45
44	600535	天士力	29,200	1,252,388.00	0.45
45	600690	青岛海尔	64,000	1,248,000.00	0.44
46	600832	东方明珠	127,300	1,243,721.00	0.44
47	600372	中航电子	50,900	1,214,474.00	0.43
48	600048	保利地产	145,904	1,203,708.00	0.43

49	600171	上海贝岭	132,600	1,197,378.00	0.43
50	601607	上海医药	78,100	1,155,099.00	0.41
51	600682	南京新百	100,300	1,139,408.00	0.41
52	601117	中国化学	140,700	1,125,600.00	0.40
53	601877	正泰电器	44,478	1,106,612.64	0.39
54	600583	海油工程	142,600	1,106,576.00	0.39
55	600518	康美药业	61,400	1,105,200.00	0.39
56	600050	中国联通	342,900	1,100,709.00	0.39
57	601688	华泰证券	122,300	1,095,808.00	0.39
58	600150	中国船舶	45,154	1,092,275.26	0.39
59	600011	华能国际	212,700	1,076,262.00	0.38
60	601339	百隆东方	106,100	1,074,793.00	0.38
61	600126	杭钢股份	276,700	1,073,596.00	0.38
62	601800	中国交建	265,569	1,072,898.76	0.38
63	600256	广汇能源	122,215	1,068,159.10	0.38
64	600597	光明乳业	47,900	1,063,380.00	0.38
65	600111	包钢稀土	47,600	1,060,052.00	0.38
66	600703	三安光电	42,600	1,056,054.00	0.38
67	600118	中国卫星	56,910	1,054,542.30	0.38
68	601238	广汽集团	126,900	1,045,656.00	0.37
69	600085	同仁堂	48,300	1,033,620.00	0.37
70	600894	广日股份	85,900	1,032,518.00	0.37
71	600598	北大荒	90,800	1,026,948.00	0.37
72	601158	重庆水务	173,800	1,023,682.00	0.36
73	600600	青岛啤酒	20,900	1,023,055.00	0.36
74	600637	百视通	27,600	1,020,372.00	0.36
75	600089	特变电工	94,800	1,016,256.00	0.36
76	600664	哈药股份	161,940	992,692.20	0.35
77	600551	时代出版	60,700	990,017.00	0.35
78	601231	环旭电子	46,200	972,510.00	0.35
79	600270	外运发展	95,300	971,107.00	0.35
80	600770	综艺股份	115,200	968,832.00	0.35
81	601186	中国铁建	206,400	968,016.00	0.35
82	600031	三一重工	150,000	963,000.00	0.34
83	600674	川投能源	85,967	959,391.72	0.34
84	601727	上海电气	258,900	957,930.00	0.34
85	600998	九州通	63,600	953,364.00	0.34
86	600406	国电南瑞	64,070	952,720.90	0.34
87	601336	新华保险	41,200	942,656.00	0.34
88	601018	宁波港	376,500	918,660.00	0.33
89	600007	中国国贸	86,300	915,643.00	0.33



90	601390	中国中铁	341,600	915,488.00	0.33
91	601099	太平洋	153,290	912,075.50	0.33
92	600020	中原高速	406,700	902,874.00	0.32
93	600066	宇通客车	51,324	901,249.44	0.32
94	600109	国金证券	53,100	901,107.00	0.32
95	601991	大唐发电	212,400	900,576.00	0.32
96	600624	复旦复华	96,500	895,520.00	0.32
97	601555	东吴证券	103,800	892,680.00	0.32
98	600601	方正科技	319,300	887,654.00	0.32
99	600121	郑州煤电	175,400	884,016.00	0.32
100	600893	航空动力	46,200	883,806.00	0.32
101	601888	中国国旅	24,900	869,010.00	0.31
102	600834	申通地铁	126,600	865,944.00	0.31
103	601618	中国中冶	494,400	865,200.00	0.31
104	600383	金地集团	129,000	861,720.00	0.31
105	600741	华域汽车	84,400	855,816.00	0.31
106	600100	同方股份	82,700	841,059.00	0.30
107	600271	航天信息	41,300	833,021.00	0.30
108	600819	耀皮玻璃	134,100	832,761.00	0.30
109	600863	内蒙华电	244,000	832,040.00	0.30
110	601098	中南传媒	75,400	828,646.00	0.30
111	600795	国电电力	351,900	826,965.00	0.29
112	601933	永辉超市	62,200	826,638.00	0.29
113	600010	包钢股份	191,300	824,503.00	0.29
114	601718	际华集团	297,000	822,690.00	0.29
115	600062	华润双鹤	36,701	821,001.37	0.29
116	600369	西南证券	82,300	817,239.00	0.29
117	600781	上海辅仁	55,200	816,960.00	0.29
118	600340	华夏幸福	40,125	811,728.75	0.29
119	601777	力帆股份	126,400	810,224.00	0.29
120	600798	宁波海运	229,600	808,192.00	0.29
121	601377	兴业证券	85,200	805,992.00	0.29
122	600569	安阳钢铁	464,100	802,893.00	0.29
123	600875	东方电气	63,800	801,966.00	0.29
124	600315	上海家化	18,850	796,035.50	0.28
125	600350	山东高速	262,300	794,769.00	0.28
126	600377	宁沪高速	142,200	793,476.00	0.28
127	600861	北京城乡	100,300	793,373.00	0.28
128	601669	中国电建	255,800	785,306.00	0.28
129	601992	金隅股份	114,400	777,920.00	0.28
130	600282	南钢股份	402,400	776,632.00	0.28

131	600575	芜湖港	237,500	769,500.00	0.27
132	600665	天地源	237,500	769,500.00	0.27
133	601600	中国铝业	225,400	766,360.00	0.27
134	601801	皖新传媒	61,400	765,658.00	0.27
135	600143	金发科技	137,206	762,865.36	0.27
136	600803	威远生化	61,390	761,849.90	0.27
137	601788	光大证券	87,100	756,899.00	0.27
138	601899	紫金矿业	327,300	756,063.00	0.27
139	600588	用友软件	54,480	754,003.20	0.27
140	601588	北辰实业	280,000	753,200.00	0.27
141	600108	亚盛集团	92,200	740,366.00	0.26
142	601558	华锐风电	179,302	736,931.22	0.26
143	601678	滨化股份	95,050	734,736.50	0.26
144	600103	青山纸业	317,600	733,656.00	0.26
145	600697	欧亚集团	39,100	732,343.00	0.26
146	600208	新湖中宝	228,440	731,008.00	0.26
147	601179	中国西电	223,200	729,864.00	0.26
148	601106	中国一重	347,900	727,111.00	0.26
149	600188	兖州煤业	80,801	717,512.88	0.26
150	601111	中国国航	181,000	714,950.00	0.25
151	600267	海正药业	48,000	711,360.00	0.25
152	600352	浙江龙盛	53,700	709,914.00	0.25
153	600850	华东电脑	33,790	707,562.60	0.25
154	600497	驰宏锌锗	75,373	706,245.01	0.25
155	600332	白云山	25,500	705,330.00	0.25
156	601898	中煤能源	147,800	705,006.00	0.25
157	600726	华电能源	285,300	698,985.00	0.25
158	600415	小商品城	118,300	694,421.00	0.25
159	600557	康缘药业	22,800	693,576.00	0.25
160	600844	丹化科技	92,700	688,761.00	0.25
161	600403	大有能源	95,800	682,096.00	0.24
162	600198	大唐电信	50,900	675,952.00	0.24
163	600019	宝钢股份	165,100	675,259.00	0.24
164	600655	豫园商城	86,900	674,344.00	0.24
165	600221	海南航空	333,200	666,400.00	0.24
166	600006	东风汽车	228,900	666,099.00	0.24
167	600747	大连控股	174,700	662,113.00	0.24
168	600489	中金黄金	76,860	657,153.00	0.23
169	600578	京能电力	181,000	657,030.00	0.23
170	600307	酒钢宏兴	248,400	650,808.00	0.23
171	600547	山东黄金	37,701	650,342.25	0.23

172	600229	青岛碱业	107,300	648,092.00	0.23
173	600820	隧道股份	71,000	643,970.00	0.23
174	601958	金钼股份	88,600	642,350.00	0.23
175	601928	凤凰传媒	66,900	639,564.00	0.23
176	600115	东方航空	230,300	637,931.00	0.23
177	600987	航民股份	112,650	636,472.50	0.23
178	600809	山西汾酒	32,602	629,218.60	0.22
179	600054	黄山旅游	61,301	628,948.26	0.22
180	601168	西部矿业	114,600	617,694.00	0.22
181	600814	杭州解百	87,400	617,044.00	0.22
182	601369	陕鼓动力	92,050	612,132.50	0.22
183	600423	柳化股份	147,600	611,064.00	0.22
184	601699	潞安环能	56,800	606,056.00	0.22
185	600236	桂冠电力	192,900	603,777.00	0.22
186	600149	廊坊发展	106,500	597,465.00	0.21
187	600804	鹏博士	42,300	594,738.00	0.21
188	600079	人福医药	20,300	575,505.00	0.21
189	601139	深圳燃气	71,200	563,192.00	0.20
190	600166	福田汽车	107,000	545,700.00	0.19
191	601001	大同煤业	92,700	535,806.00	0.19
192	600362	江西铜业	36,901	523,256.18	0.19
193	600633	浙报传媒	17,200	522,364.00	0.19
194	600589	广东榕泰	103,000	518,090.00	0.18
195	600348	阳泉煤业	72,800	513,968.00	0.18
196	600765	中航重机	40,600	508,312.00	0.18
197	600549	厦门钨业	19,400	466,376.00	0.17
198	600498	烽火通信	28,800	443,520.00	0.16
199	600867	通化东宝	26,900	411,839.00	0.15
200	600691	阳煤化工	52,000	322,400.00	0.11

### 8.3.2 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	601857	中国石油	1,860,807.22	0.52
2	600121	郑州煤电	1,331,402.28	0.37
3	600863	内蒙华电	1,247,840.88	0.35
4	600587	新华医疗	1,119,527.60	0.31

5	600834	申通地铁	1,114,905.01	0.31
6	600894	广日股份	1,094,033.84	0.30
7	601339	百隆东方	1,074,009.50	0.30
8	600423	柳化股份	1,067,993.00	0.30
9	600118	中国卫星	1,003,285.45	0.28
10	600624	复旦复华	986,595.02	0.27
11	600089	特变电工	944,951.00	0.26
12	600850	华东电脑	936,210.50	0.26
13	601928	凤凰传媒	906,307.00	0.25
14	600578	京能电力	893,904.32	0.25
15	600180	瑞茂通	867,662.00	0.24
16	601139	深圳燃气	862,627.00	0.24
17	600765	中航重机	859,855.70	0.24
18	600036	招商银行	850,830.39	0.24
19	600108	亚盛集团	832,706.66	0.23
20	600198	大唐电信	830,168.28	0.23

#### 8.4.2 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	600780	通宝能源	1,820,240.92	0.51
2	600804	鹏博士	1,599,931.84	0.44
3	600775	南京熊猫	1,416,235.58	0.39
4	600277	亿利能源	1,412,094.41	0.39
5	600036	招商银行	1,389,793.43	0.39
6	600016	民生银行	1,358,545.34	0.38
7	600803	威远生化	1,254,883.84	0.35
8	601005	重庆钢铁	1,073,685.57	0.30
9	600757	长江传媒	1,008,180.96	0.28
10	600648	外高桥	957,951.78	0.27
11	600987	航民股份	915,130.13	0.25
12	600694	大商股份	869,833.00	0.24
13	600510	黑牡丹	842,852.27	0.23
14	600180	瑞茂通	819,527.92	0.23
15	600498	烽火通信	813,580.66	0.23
16	600000	浦发银行	752,566.63	0.21
17	600792	云煤能源	723,163.89	0.20
18	600058	五矿发展	707,826.98	0.20
19	600376	首开股份	701,884.78	0.20
20	600827	友谊股份	659,879.72	0.18

### 8.4.3 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	53,809,066.90
卖出股票收入（成交）总额	46,245,057.28

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	720,660.20	0.26
8	其他	—	—
9	合计	720,660.20	0.26

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113005	平安转债	4,780	512,655.00	0.18
2	110024	隧道转债	1,540	150,550.40	0.05
3	113006	深燃转债	580	57,454.80	0.02

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 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。

本期，本基金持有的中国石化于 2013 年 11 月 24 日公告其位于青岛经济技术开发区的原油管道发生破裂，在开始抢险处置后，市政排水暗渠发生爆燃，导致周边行人、抢险人员的重大伤亡，中国政府已派出事故调查组进行全面调查。

中国石化为本基金跟踪标的指数的样本股，基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余 9 名证券的发行主体本期未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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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	3,968.05
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	840.47
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,808.52

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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(%)
861	143,598.74	115,204,638.00	93.18	8,433,875.00	6.82

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行股份有限公司—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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中国工商银行股份有限公司—富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	109,621,447	88.66
2	国元证券股份有限公司	3,422,321	2.77
3	上海安信农业保险股份有限公司	1,711,160	1.38
4	孙明建	500,000	0.40
5	王月华	400,000	0.32
6	上海市民帮困互助基金会	342,232	0.28
7	李桂平	172,759	0.14
8	王晓健	172,100	0.14
9	陈宝联	171,116	0.14
10	李莉	169,747	0.14

### 9.3 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	0.00	0.0000

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2、本基金的基金经理未持有本基金。

### § 10 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	320,363,407.00
报告期期初基金份额总额	152,638,513.00
本报告期基金总申购份额	11,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	40,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	123,638,513.00

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 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。

#### 11.2 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，基金管理人公告窦玉明先生自2013年6月5日不再担任公司总经理职务，并自该日起由公司董事长陈敏女士代行公司总经理职责。

本基金管理人已于2014年1月29日和2014年1月30日发布公告，陈戈先生自2014年1月29日起由公司副总经理转任公司总经理。

#### 11.3 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。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

#### 11.5 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。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为5万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为11年。

#### 11.6 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和基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。



### 11.7 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	99,058,457.93	100.00	—	—	—	—	—	—	90,182.49	100.00	—

注：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。本报告期本基金退租券商交易单元：中信证券 25347。其余租用券商交易单元未发生变动。

## 11.8 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提请广大投资者持有效身份证件办理相关业务的公告	中国证券报、公司网站	2013年01月04日
2	富国基金管理有限公司关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金调整成份股的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2013年02月21日
3	富国基金管理有限公司关于撤销深圳分公司的公告	中国证券报、公司网站	2013年04月18日
4	富国基金管理有限公司关于高管人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2013年06月07日
5	富国基金管理有限公司关于设立子公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2013年08月16日
6	富国基金管理有限公司关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金调整成份股的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2013年08月29日

## § 12 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上证综指交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、上证综指交易型开放	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：

<p>式指数证券投资基金托管协议</p> <p>4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件</p> <p>5、上证综指交易型开放式指数证券投资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>		<p><a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a></p>
--	--	--