

富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

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： 中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	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.....	11
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.....	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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.....	39
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.9	投资组合报告附注.....	40
§8	基金份额持有人信息.....	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	41
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42

§9	开放式基金份额变动.....	42
§10	重大事件揭示.....	42
10.1	基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4	基金投资策略的改变.....	42
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	富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)
基金简称	富国中证 500 指数增强 (LOF) (场内简称: 富国 500)
基金主代码	161017
交易代码	前端交易代码: 161017 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 10 月 12 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	335,369,106.69 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011-10-21

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,在力求对中证 500 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	本基金业绩比较基准=95%×中证 500 指数收益率+1%(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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林志松	李芳菲
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-63201816
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	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道	北京市西城区复兴门内大街

	8号上海国金中心二期 16-17层	28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	陈敏	蒋超良

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世纪大道8号上海 国金中心二期16-17层 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28号凯晨世贸中心东座F9 深圳证券交易所 深圳市深南东路5045号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§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	-9,414,921.48
本期利润	6,128,412.10
加权平均基金份额本期利润	0.0235
本期加权平均净值利润率	2.46%
本期基金份额净值增长率	9.66%
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	-34,130,693.05
期末可供分配基金份额利润	-0.1018
期末基金资产净值	312,099,363.34
期末基金份额净值	0.931
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	-6.90%

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）。

本基金合同生效日为 2011 年 10 月 12 日，截至报告期末本基金合同生效不满一年。

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	-6.34%	1.18%	-7.08%	1.18%	0.74%	0.00%
过去三个月	2.76%	1.21%	1.78%	1.16%	0.98%	0.05%
过去六个月	9.66%	1.55%	6.54%	1.53%	3.12%	0.02%
自基金合同生效日起至今	-6.90%	1.48%	-7.89%	1.57%	0.99%	-0.09%

注：

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%×中证 500 指数收益率+1%(指年收益率，评价时按期间折算)。中证 500 指数全称“中证小盘 500 指数”，它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场中小市值公司的整体状况。

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

$$\text{benchmark}_t = 95\% * [\text{中证 500 指数}_t / (\text{中证 500 指数}_{t-T}) - 1] + [(1+0.01)^{(1/250)} - 1];$$

其中，t=1,2,3,...,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：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中，T=2,3,4,...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 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：截止日期为 2012 年 6 月 30 日。

本基金建仓期 6 个月，即从 2011 年 10 月 12 日起至 2012 年 4 月 11 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、富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理	2011-10-12	—	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。
徐幼华	本基金基金经理兼任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理	2011-10-12	—	8 年	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理；2006 年 7 月至 2008 年 12 月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员，2009 年 1 月至 2011 年 5 月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员、基金经理助理，2011 年 5 月起任富国中证红利指数增强

					型证券投资基金基金经理，2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。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、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合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)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》、《富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)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 3.45%累积超额收益(相对于 95%*中证 500 指数)。而且从稳定性来看,上半年的 6 个月中,有 5 个月战胜了基准,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,中证 500 指数上半年上涨 6.25%。

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 0.931 元,份额累计净值为 0.931 元。报告期内,本基金份额净值增长率为 9.66%,同期业绩比较基准收益率为 6.54%。

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

在托管富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)合同》、《富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)托管协议》的约定,对富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)管理人—富国基金管理有限公司 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,富国基金管理有限公司在富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,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真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部
2012 年 8 月 23 日

§ 6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)
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)
资产:		
银行存款	17,335,611.45	9,382,168.07
结算备付金	523,823.13	1,353,320.02
存出保证金	—	—
交易性金融资产	295,159,263.23	160,252,500.68

其中：股票投资	295,159,263.23	160,252,500.68
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	—	15,175.65
应收利息	3,859.22	2,719.84
应收股利	65,971.80	—
应收申购款	188,548.83	71,919.38
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	313,277,077.66	171,077,803.64
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2012年06月30日)	(2011年12月31日)
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	302,108.42	590,288.71
应付管理人报酬	268,031.53	160,825.22
应付托管费	40,204.70	24,123.78
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	312,354.79	519,202.34
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	255,014.88	182,224.66
负债合计	1,177,714.32	1,476,664.71
所有者权益：		
实收基金	335,369,106.69	199,861,533.26
未分配利润	-23,269,743.35	-30,260,394.33
所有者权益合计	312,099,363.34	169,601,138.93
负债和所有者权益总计	313,277,077.66	171,077,803.64

注：报告截止日 2012 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.931 元，基金份额总额 335,369,106.69 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

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)
一、收入	8,846,962.59
1. 利息收入	62,312.95
其中：存款利息收入	62,312.95
债券利息收入	—
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）	-6,919,149.46
其中：股票投资收益	-8,816,023.63
基金投资收益	—
债券投资收益	—
资产支持证券投资收益	—
衍生工具投资收益	—
股利收益	1,896,874.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	15,543,333.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	160,465.52
减：二、费用	2,718,550.49
1. 管理人报酬	1,217,705.39
2. 托管费	182,655.75
3. 销售服务费	—
4. 交易费用	1,012,254.19
5. 利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 其他费用	305,935.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	6,128,412.10
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	6,128,412.10

注：本基金合同生效日为2011年10月12日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)

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）	199,861,533.26	-30,260,394.33	169,601,138.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	6,128,412.10	6,128,412.10
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）	135,507,573.43	862,238.88	136,369,812.31
其中：1. 基金申购款	273,454,173.38	-8,715,999.74	264,738,173.64
2. 基金赎回款	-137,946,599.95	9,578,238.62	-128,368,361.33
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）	335,369,106.69	-23,269,743.35	312,099,363.34

注：本基金合同生效日为2011年10月12日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

窦玉明

林志松

雷青松

基金管理人负责人

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

富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)（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[2011]1095号《关于核准富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)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2011年09月09日至2011年09月28日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所有限责任公司验证并出具安永华明(2011)验字第60467606_B05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10月12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455,241,485.70元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币245,764.18元，以上实收基金（本息）合计为人民币455,487,249.88元，折合455,487,249.88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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中，股票资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于中证500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%×中证500指数收益率+1%（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 日的财务状况以及自 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	17,335,611.45
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	17,335,611.45

注：本基金本期末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	306,822,795.40	295,159,263.23	-11,663,532.17
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	306,822,795.40	295,159,263.23	-11,663,532.17

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：本基金本报告期末均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	3,647.00
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	212.22
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	3,859.22

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

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	312,354.79
银行间市场应付交易费用	—
合计	312,354.79

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	1,138.48
预提上市年费	29,835.26
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	149,178.12
应付指数使用费	50,000.00
合计	255,014.88

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	199,861,533.26	199,861,533.26
本期申购	273,454,173.38	273,454,173.38
本期赎回（以“-”号填列）	-137,946,599.95	-137,946,599.95
本期末	335,369,106.69	335,369,106.69

注：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	-7,362,871.75	-22,897,522.58	-30,260,394.33
本期利润	-9,414,921.48	15,543,333.58	6,128,412.10
本期基金份额交易产生的变动数	-17,352,899.82	18,215,138.70	862,238.88

其中：基金申购款	-29,698,956.14	20,982,956.40	-8,715,999.74
基金赎回款	12,346,056.32	-2,767,817.70	9,578,238.62
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-34,130,693.05	10,860,949.70	-23,269,743.35

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	55,596.54
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	6,716.41
其他	—
合计	62,312.95

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	287,757,177.33
减：卖出股票成本总额	296,573,200.96
买卖股票差价收入	-8,816,023.63

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本期末未买卖权证差价收入。

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	1,896,874.17
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,896,874.17

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	15,543,333.58
股票投资	15,543,333.58
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	15,543,333.58

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	160,465.52
合计	160,465.52

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	1,012,254.19
银行间市场交易费用	—
合计	1,012,254.19

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	24,863.02
信息披露费	149,178.12
银行汇划费用	2,058.76
上市费	29,835.26
指数使用费	100,000.00
合计	305,935.16

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、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
中国农业银行股份有限公司	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）
-------	-----------------------------

	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
海通证券	64,654,961.29	9.24
申银万国	63,970,849.12	9.14

注：本基金合同生效日为 2011 年 10 月 12 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本期间未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2011 年 10 月 12 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本期间未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效日为 2011 年 10 月 12 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本期间未通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为 2011 年 10 月 12 日，无上年度同期对比数据。

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	52,532.34	8.96	23,501.49	7.52
申银万国	54,415.86	9.28	24,702.54	7.91

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。本基金本期间未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2011 年 10 月 12 日，无上年度同期对比数据。

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）
当期发生的基金应支付的管理费	1,217,705.39
其中：支付销售机构的客户维护费	306,204.71

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。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

基金管理费每日计提，按月支付。

本基金合同生效日是 2011 年 10 月 12 日，无上年度同期对比数据。

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）
当期发生的基金应支付的托管费	182,655.75

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计提，按月支付。

本基金合同生效日是2011年10月12日，无上年度同期对比数据。

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进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金合同生效日为2011年12月10日，无上年度同期对比数据。

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）
基金合同生效日(2011年10月12日)持有的基金份额	—
期初持有的基金份额	20,003,333.00
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	20,000,000.00
期末持有的基金份额	3,333.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

注：本基金管理人认购/申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：本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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）	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	17,335,611.45	55,596.54

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率计息。

本基金合同生效日是2011年10月12日，无上年度同期对比数据。

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：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

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
000059	辽通化工	2012-06-26	筹划重大事项	7.91	2012-07-03	8.15	26,232	256,461.32	207,495.12	—
600436	片仔癀	2012-06-29	筹划重大事项	87.89	2012-07-02	91.19	6,590	552,527.20	579,195.10	—
600565	迪马股份	2012-05-31	筹划重大事项	4.88	2012-07-23	4.39	40	169.01	195.20	—
600780	通宝能源	2012-01-18	筹划重大事项	6.70	—	—	234,201	1,847,447.59	1,569,146.70	—

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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

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（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	17,335,611.45	—	—	—	—	—	17,335,611.45
结算备付金	523,823.13	—	—	—	—	—	523,823.13
交易性金融资产	—	—	—	—	—	295,159,263.23	295,159,263.23
应收利息	—	—	—	—	—	3,859.22	3,859.22
应收股利	—	—	—	—	—	65,971.80	65,971.80
应收申购款	188,548.83	—	—	—	—	—	188,548.83
资产总计	18,047,983.41	—	—	—	—	295,229,094.25	313,277,077.66
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	302,108.42	302,108.42
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	268,031.53	268,031.53
应付托管费	—	—	—	—	—	40,204.70	40,204.70
应付交易费用	—	—	—	—	—	312,354.79	312,354.79
其他负债	—	—	—	—	—	255,014.88	255,014.88
负债总计	—	—	—	—	—	1,177,714.32	1,177,714.32
利率敏感度缺口	18,047,983.41	—	—	—	—	294,051,379.93	312,099,363.34
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	9,382,168.07	—	—	—	—	—	9,382,168.07
结算备付金	1,353,320.02	—	—	—	—	—	1,353,320.02
交易性金融资产	—	—	—	—	—	160,252,500.68	160,252,500.68
应收证券清算款	—	—	—	—	—	15,175.65	15,175.65
应收利息	—	—	—	—	—	2,719.84	2,719.84
应收申购款	71,919.38	—	—	—	—	—	71,919.38
资产总计	10,807,407.47	—	—	—	—	160,270,396.17	171,077,803.64
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	590,288.71	590,288.71
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	160,825.22	160,825.22
应付托管费	—	—	—	—	—	24,123.78	24,123.78
应付交易费用	—	—	—	—	—	519,202.34	519,202.34
其他负债	—	—	—	—	—	182,224.66	182,224.66
负债总计	—	—	—	—	—	1,476,664.71	1,476,664.71
利率敏感度缺口	10,807,407.47	—	—	—	—	158,793,731.46	169,601,138.93

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,因此无重大外汇风险。

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

本基金投资组合中股票资产投资比例不低于基金资产的90%,投资于中证500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列示如下:

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	295,159,263.23	94.57	160,252,500.68	94.49
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	295,159,263.23	94.57	160,252,500.68	94.49

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。		
	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）
分析	1. 业绩比较基准增加 1%	3,131,008.29	1,157,118.91
	2. 业绩比较基准减少 1%	-3,131,008.29	-1,157,118.91

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	295,159,263.23	94.22
	其中：股票	295,159,263.23	94.22
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	17,859,434.58	5.70
6	其他各项资产	258,379.85	0.08
7	合计	313,277,077.66	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	75,846.40	0.02

B	采掘业	2,419,349.24	0.78
C	制造业	29,042,739.77	9.31
C0	食品、饮料	3,945,589.70	1.26
C1	纺织、服装、皮毛	567,326.46	0.18
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	1,972,429.30	0.63
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,479,735.01	1.11
C5	电子	953,128.52	0.31
C6	金属、非金属	1,341,352.00	0.43
C7	机械、设备、仪表	14,018,675.78	4.49
C8	医药、生物制品	2,764,503.00	0.89
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	568,201.44	0.18
E	建筑业	3,263,603.20	1.05
F	交通运输、仓储业	3,483,595.30	1.12
G	信息技术业	2,826,649.88	0.91
H	批发和零售贸易	5,264,194.20	1.69
I	金融、保险业	—	—
J	房地产业	1,014,306.84	0.32
K	社会服务业	1,989,856.77	0.64
L	传播与文化产业	2,840,062.12	0.91
M	综合类	721,050.00	0.23
	合计	53,509,455.16	17.15

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	2,432,119.44	0.78
B	采掘业	6,874,885.89	2.20
C	制造业	128,041,855.87	41.03
C0	食品、饮料	14,109,578.24	4.52
C1	纺织、服装、皮毛	7,575,285.66	2.43
C2	木材、家具	729,920.60	0.23
C3	造纸、印刷	1,528,946.84	0.49
C4	石油、化学、塑胶、塑料	25,894,347.31	8.30
C5	电子	25,192,833.00	8.07
C6	金属、非金属	4,788,380.69	1.53
C7	机械、设备、仪表	25,292,883.74	8.10
C8	医药、生物制品	20,125,887.95	6.45
C99	其他制造业	2,803,791.84	0.90
D	电力、煤气及水的生产和供应业	9,349,598.60	3.00

E	建筑业	10,666,780.29	3.42
F	交通运输、仓储业	12,538,128.26	4.02
G	信息技术业	13,200,332.84	4.23
H	批发和零售贸易	5,668,250.58	1.82
I	金融、保险业	4,391,248.73	1.41
J	房地产业	21,949,140.35	7.03
K	社会服务业	5,770,948.17	1.85
L	传播与文化产业	12,969,874.15	4.16
M	综合类	7,796,644.90	2.50
	合计	241,649,808.07	77.43

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	600820	隧道股份	572,500	5,095,250.00	1.63
2	000970	中科三环	125,701	4,987,815.68	1.60
3	600227	赤天化	1,276,163	4,785,611.25	1.53
4	000799	酒鬼酒	89,836	4,707,406.40	1.51
5	000830	鲁西化工	988,512	4,487,844.48	1.44
6	600322	天房发展	1,228,042	4,384,109.94	1.40
7	600004	白云机场	629,542	4,287,181.02	1.37
8	600702	沱牌舍得	115,022	4,169,547.50	1.34
9	600748	上实发展	691,647	4,156,798.47	1.33
10	600584	长电科技	792,182	3,802,473.60	1.22
11	600328	兰太实业	431,788	3,514,754.32	1.13
12	002008	大族激光	553,932	3,478,692.96	1.11
13	600487	亨通光电	179,149	3,443,243.78	1.10
14	000650	仁和药业	400,447	3,435,835.26	1.10
15	002154	报喜鸟	248,118	3,381,848.34	1.08
16	600195	中牧股份	189,256	3,228,707.36	1.03
17	600157	永泰能源	349,400	3,172,552.00	1.02
18	600060	海信电器	186,000	3,126,660.00	1.00
19	600373	中文传媒	217,200	3,118,992.00	1.00
20	600743	华远地产	778,100	3,081,276.00	0.99
21	002029	七匹狼	105,026	2,919,722.80	0.94
22	600435	北方导航	362,600	2,839,158.00	0.91

23	600284	浦东建设	388,022	2,824,800.16	0.91
24	600810	神马股份	334,363	2,785,243.79	0.89
25	000823	超声电子	196,900	2,746,755.00	0.88
26	600827	友谊股份	242,175	2,738,999.25	0.88
27	000975	科学城	326,800	2,712,440.00	0.87
28	600139	西部资源	293,881	2,700,766.39	0.87
29	600366	宁波韵升	128,841	2,674,739.16	0.86
30	000563	陕国投 A	186,901	2,566,150.73	0.82
31	601107	四川成渝	726,850	2,514,901.00	0.81
32	000537	广宇发展	338,521	2,433,965.99	0.78
33	600717	天津港	385,000	2,433,200.00	0.78
34	600880	博瑞传播	237,945	2,372,311.65	0.76
35	600277	亿利能源	457,350	2,341,632.00	0.75
36	600386	北巴传媒	306,000	2,319,480.00	0.74
37	600067	冠城大通	405,680	2,259,637.60	0.72
38	600129	太极集团	314,002	2,257,674.38	0.72
39	000090	深天健	299,640	2,166,397.20	0.69
40	000543	皖能电力	299,800	2,101,598.00	0.67
41	000066	长城电脑	519,756	2,047,838.64	0.66
42	600648	外高桥	232,700	1,966,315.00	0.63
43	000301	东方市场	654,900	1,951,602.00	0.63
44	002306	湘鄂情	179,600	1,930,700.00	0.62
45	600510	黑牡丹	265,397	1,924,128.25	0.62
46	600086	东方金钰	145,400	1,913,464.00	0.61
47	600657	信达地产	423,800	1,877,434.00	0.60
48	600643	爱建股份	221,224	1,825,098.00	0.58
49	600787	中储股份	204,500	1,815,960.00	0.58
50	000683	远兴能源	320,468	1,810,644.20	0.58
51	600831	广电网络	224,300	1,801,129.00	0.58
52	600038	哈飞股份	106,106	1,770,909.14	0.57
53	000631	顺发恒业	337,409	1,737,656.35	0.56
54	000930	中粮生化	330,837	1,607,867.82	0.52
55	000919	金陵药业	187,217	1,576,367.14	0.51
56	600202	哈空调	294,500	1,575,575.00	0.50
57	000685	中山公用	107,900	1,574,261.00	0.50
58	600780	通宝能源	234,201	1,569,146.70	0.50
59	002362	汉王科技	140,300	1,555,927.00	0.50
60	002480	新筑股份	151,060	1,551,386.20	0.50
61	002429	兆驰股份	136,200	1,539,060.00	0.49
62	600021	上海电力	278,100	1,529,550.00	0.49
63	000597	东北制药	218,502	1,507,663.80	0.48

64	600289	亿阳信通	239,200	1,463,904.00	0.47
65	600805	悦达投资	154,600	1,442,418.00	0.46
66	600480	凌云股份	179,178	1,433,424.00	0.46
67	002276	万马电缆	259,000	1,398,600.00	0.45
68	600523	贵航股份	145,900	1,370,001.00	0.44
69	002181	粤传媒	144,600	1,366,470.00	0.44
70	600311	荣华实业	169,800	1,358,400.00	0.44
71	601000	唐山港	203,546	1,351,545.44	0.43
72	000601	韶能股份	351,675	1,343,398.50	0.43
73	002011	盾安环境	125,100	1,332,315.00	0.43
74	600594	益佰制药	66,970	1,326,006.00	0.42
75	002477	雏鹰农牧	69,428	1,308,717.80	0.42
76	600308	华泰股份	362,812	1,295,238.84	0.42
77	002065	东华软件	58,130	1,290,486.00	0.41
78	600872	中炬高新	250,200	1,281,024.00	0.41
79	000636	风华高科	172,600	1,277,240.00	0.41
80	600420	现代制药	88,700	1,204,546.00	0.39
81	600525	长园集团	163,899	1,157,126.94	0.37
82	000050	深天马 A	176,004	1,149,306.12	0.37
83	000893	东凌粮油	81,528	1,148,729.52	0.37
84	000028	国药一致	38,400	1,143,552.00	0.37
85	000513	丽珠集团	39,900	1,108,821.00	0.36
86	600590	泰豪科技	162,062	1,106,883.46	0.35
87	000726	鲁泰 A	152,723	1,105,714.52	0.35
88	002384	东山精密	96,398	1,098,937.20	0.35
89	600521	华海药业	71,000	1,072,810.00	0.34
90	000533	万家乐	251,208	1,052,561.52	0.34
91	600601	方正科技	407,300	1,022,323.00	0.33
92	000598	兴蓉投资	124,587	1,015,384.05	0.33
93	600637	百视通	76,845	1,006,669.50	0.32
94	600488	天药股份	177,300	991,107.00	0.32
95	600363	联创光电	139,280	980,531.20	0.31
96	600580	卧龙电气	192,700	965,427.00	0.31
97	002601	佰利联	12,074	942,979.40	0.30
98	002585	双星新材	75,184	942,807.36	0.30
99	000751	*ST 锌业	282,957	930,928.53	0.30
100	601678	滨化股份	84,900	905,034.00	0.29
101	600864	哈投股份	134,022	830,936.40	0.27
102	600789	鲁抗医药	166,716	820,242.72	0.26
103	002238	天威视讯	57,000	811,110.00	0.26
104	002028	思源电气	71,601	794,055.09	0.25

105	600507	方大特钢	195,900	762,051.00	0.24
106	002410	广联达	30,998	760,690.92	0.24
107	002172	澳洋科技	175,250	748,317.50	0.24
108	000659	珠海中富	220,000	743,600.00	0.24
109	000910	大亚科技	148,660	729,920.60	0.23
110	600416	湘电股份	109,300	725,752.00	0.23
111	000998	隆平高科	40,650	724,789.50	0.23
112	600325	华发股份	83,670	712,868.40	0.23
113	002428	云南锗业	33,292	696,801.56	0.22
114	600360	华微电子	169,000	665,860.00	0.21
115	600198	大唐电信	64,300	647,501.00	0.21
116	000979	中弘股份	86,400	639,360.00	0.20
117	000594	国恒铁路	244,300	598,535.00	0.19
118	600436	片仔癀	6,590	579,195.10	0.19
119	600723	首商股份	66,128	555,475.20	0.18
120	000426	兴业矿业	38,610	515,443.50	0.17
121	002062	宏润建设	104,341	493,532.93	0.16
122	002345	潮宏基	20,736	480,867.84	0.15
123	000989	九芝堂	29,100	471,420.00	0.15
124	600199	金种子酒	18,400	459,632.00	0.15
125	002340	格林美	32,400	431,244.00	0.14
126	600829	三精制药	35,100	407,862.00	0.13
127	600651	飞乐音响	57,700	407,362.00	0.13
128	002110	三钢闽光	65,487	388,992.78	0.12
129	600290	华仪电气	57,400	374,248.00	0.12
130	600110	中科英华	94,700	367,436.00	0.12
131	600288	大恒科技	56,900	357,332.00	0.11
132	601126	四方股份	24,300	355,509.00	0.11
133	002383	合众思壮	20,670	352,423.50	0.11
134	000962	东方钨业	25,975	347,026.00	0.11
135	600667	太极实业	62,300	311,500.00	0.10
136	601588	北辰实业	108,700	309,795.00	0.10
137	000786	北新建材	23,684	306,470.96	0.10
138	600622	嘉宝集团	47,551	292,438.65	0.09
139	000708	大冶特钢	31,623	288,401.76	0.09
140	000926	福星股份	29,600	276,464.00	0.09
141	002129	中环股份	19,600	251,860.00	0.08
142	600469	风神股份	26,100	230,724.00	0.07
143	600300	维维股份	23,500	222,780.00	0.07
144	600291	西水股份	33,100	222,101.00	0.07
145	002309	中利科技	22,102	215,273.48	0.07

146	000972	*ST 中基	64,400	209,300.00	0.07
147	600830	香溢融通	21,989	185,147.38	0.06
148	600467	好当家	24,776	175,909.60	0.06
149	000903	云内动力	40,500	172,125.00	0.06
150	600761	安徽合力	19,307	166,426.34	0.05
151	600707	彩虹股份	28,100	166,352.00	0.05
152	600293	三峡新材	22,500	165,600.00	0.05
153	000875	吉电股份	55,500	164,280.00	0.05
154	601801	皖新传媒	14,200	153,928.00	0.05
155	002191	劲嘉股份	15,500	153,760.00	0.05
156	600423	柳化股份	20,709	131,502.15	0.04
157	600333	长春燃气	18,400	127,696.00	0.04
158	600704	物产中大	13,950	124,294.50	0.04
159	000735	罗牛山	25,338	122,382.54	0.04
160	002121	科陆电子	13,710	121,470.60	0.04
161	000407	胜利股份	18,600	115,134.00	0.04
162	000822	山东海化	23,600	112,808.00	0.04
163	600292	九龙电力	8,200	108,732.00	0.03
164	000826	桑德环境	4,600	105,340.00	0.03
165	600122	宏图高科	22,805	103,534.70	0.03
166	600141	兴发集团	4,893	101,236.17	0.03
167	600359	*ST 新农	17,600	100,320.00	0.03
168	002475	立讯精密	3,262	96,392.10	0.03
169	601566	九牧王	3,200	89,120.00	0.03
170	000400	许继电气	5,600	87,752.00	0.03
171	600675	中华企业	18,590	87,001.20	0.03
172	600496	精工钢构	11,200	86,800.00	0.03
173	600797	浙大网新	18,400	86,664.00	0.03
174	600759	正和股份	15,100	83,654.00	0.03
175	000627	天茂集团	25,350	82,387.50	0.03
176	002440	闰土股份	5,579	81,007.08	0.03
177	600966	博汇纸业	15,800	79,948.00	0.03
178	600295	鄂尔多斯	8,000	78,880.00	0.03
179	002277	友阿股份	4,955	77,347.55	0.02
180	000877	天山股份	7,816	76,206.00	0.02
181	002025	航天电器	5,200	75,660.00	0.02
182	000417	合肥百货	6,000	75,300.00	0.02
183	600636	三爱富	3,871	74,903.85	0.02
184	002320	海峡股份	6,110	74,419.80	0.02
185	000951	中国重汽	5,800	70,412.00	0.02
186	600022	山东钢铁	26,800	68,876.00	0.02

187	600059	古越龙山	4,800	68,496.00	0.02
188	600240	华业地产	7,400	66,452.00	0.02
189	601311	骆驼股份	7,000	65,030.00	0.02
190	600079	人福医药	2,801	64,955.19	0.02
191	600075	新疆天业	9,000	63,810.00	0.02
192	600581	八一钢铁	9,500	62,605.00	0.02
193	600426	华鲁恒升	8,400	62,076.00	0.02
194	600268	国电南自	6,900	61,617.00	0.02
195	600597	光明乳业	6,400	59,648.00	0.02
196	000698	沈阳化工	11,800	58,882.00	0.02
197	002408	齐翔腾达	3,564	57,950.64	0.02
198	002223	鱼跃医疗	3,900	57,915.00	0.02
199	002161	远望谷	7,400	57,276.00	0.02
200	002230	科大讯飞	2,850	56,145.00	0.02
201	600121	郑州煤电	7,000	54,880.00	0.02
202	600409	三友化工	8,131	53,095.43	0.02
203	000911	南宁糖业	5,200	51,012.00	0.02
204	600425	青松建化	4,300	50,869.00	0.02
205	600482	风帆股份	5,900	50,327.00	0.02
206	002005	德豪润达	6,200	48,236.00	0.02
207	600298	安琪酵母	1,900	46,759.00	0.01
208	600628	新世界	6,800	46,580.00	0.01
209	600468	百利电气	3,600	45,036.00	0.01
210	600064	南京高科	3,900	44,850.00	0.01
211	002006	精功科技	4,200	44,688.00	0.01
212	600869	三普药业	1,800	42,210.00	0.01
213	600210	紫江企业	10,200	42,024.00	0.01
214	600126	杭钢股份	11,430	41,033.70	0.01
215	600835	上海机电	4,675	40,812.75	0.01
216	000006	深振业 A	6,800	38,828.00	0.01
217	000973	佛塑科技	7,649	35,567.85	0.01
218	600239	云南城投	4,000	33,960.00	0.01
219	600776	东方通信	6,500	33,800.00	0.01
220	600449	宁夏建材	3,600	33,552.00	0.01
221	002056	横店东磁	2,080	33,113.60	0.01
222	600844	丹化科技	2,500	31,275.00	0.01
223	000988	华工科技	2,100	28,917.00	0.01
224	600623	双钱股份	2,776	26,982.72	0.01
225	600387	海越股份	2,300	21,068.00	0.01
226	000917	电广传媒	800	19,784.00	0.01
227	600755	厦门国贸	3,897	19,485.00	0.01

228	600017	日照港	6,900	19,044.00	0.01
229	000852	江钻股份	800	13,560.00	0.00
230	000738	中航动控	1,300	13,000.00	0.00
231	002465	海格通信	550	12,430.00	0.00
232	600570	恒生电子	900	12,348.00	0.00
233	000755	山西三维	1,700	12,223.00	0.00
234	000099	中信海直	1,400	12,138.00	0.00
235	002470	金正大	890	11,783.60	0.00
236	600867	通化东宝	1,500	11,685.00	0.00
237	002233	塔牌集团	1,080	9,979.20	0.00
238	600329	中新药业	800	9,912.00	0.00
239	000667	名流置业	4,400	9,504.00	0.00
240	600063	皖维高新	3,360	9,374.40	0.00
241	000572	海马汽车	2,860	9,323.60	0.00
242	600557	康缘药业	600	8,868.00	0.00
243	600773	西藏城投	700	8,848.00	0.00
244	601880	大连港	2,900	8,671.00	0.00
245	600138	中青旅	394	7,084.12	0.00
246	600676	交运股份	1,300	5,928.00	0.00
247	000837	秦川发展	770	5,297.60	0.00
248	600408	安泰集团	1,300	4,719.00	0.00
249	000912	泸天化	6	46.62	0.00

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	002350	北京科锐	281,049	3,232,063.50	1.04
2	601668	中国建筑	951,800	3,179,012.00	1.02
3	601098	中南传媒	262,614	2,515,842.12	0.81
4	000157	中联重科	245,400	2,461,362.00	0.79
5	600104	上汽集团	161,800	2,312,122.00	0.74
6	601919	中国远洋	484,300	2,247,152.00	0.72
7	000568	泸州老窖	50,300	2,128,193.00	0.68
8	002640	百圆裤业	79,744	1,985,625.60	0.64
9	000876	新希望	115,966	1,737,170.68	0.56
10	002367	康力电梯	207,782	1,664,333.82	0.53
11	600655	豫园商城	198,300	1,562,604.00	0.50
12	002358	森源电气	120,102	1,512,084.18	0.48
13	002450	康得新	88,320	1,405,171.20	0.45
14	002635	安洁科技	28,418	1,323,142.08	0.42

15	002565	上海绿新	104,200	1,311,878.00	0.42
16	002396	星网锐捷	85,800	1,285,284.00	0.41
17	000552	靖远煤电	77,864	1,225,579.36	0.39
18	600694	大商股份	34,900	1,167,405.00	0.37
19	002004	华邦制药	49,394	1,111,365.00	0.36
20	601866	中海集运	420,200	1,063,106.00	0.34
21	600019	宝钢股份	243,600	1,052,352.00	0.34
22	002349	精华制药	66,000	989,340.00	0.32
23	002638	勤上光电	59,300	936,940.00	0.30
24	601117	中国化学	139,601	805,497.77	0.26
25	601918	国投新集	60,900	743,589.00	0.24
26	600527	江南高纤	185,000	721,500.00	0.23
27	600881	亚泰集团	131,100	721,050.00	0.23
28	600340	华夏幸福	35,756	646,826.04	0.21
29	002033	丽江旅游	27,600	584,292.00	0.19
30	601877	正泰电器	37,100	566,146.00	0.18
31	600096	云天化	42,150	558,909.00	0.18
32	002521	齐峰股份	47,646	550,311.30	0.18
33	600500	中化国际	70,800	478,608.00	0.15
34	002611	东方精工	45,630	452,649.60	0.15
35	000883	湖北能源	70,212	447,250.44	0.14
36	600703	三安光电	31,400	427,354.00	0.14
37	002522	浙江众成	24,100	425,606.00	0.14
38	002322	理工监测	22,467	407,102.04	0.13
39	002398	建研集团	16,300	371,314.00	0.12
40	600196	复星医药	35,100	361,881.00	0.12
41	002042	华孚色纺	70,200	332,046.00	0.11
42	601928	凤凰传媒	37,700	324,220.00	0.10
43	600376	首开股份	22,590	299,091.60	0.10
44	600062	华润双鹤	12,800	244,224.00	0.08
45	002456	欧菲光	7,900	234,630.00	0.08
46	000059	辽通化工	26,232	207,495.12	0.07
47	600166	福田汽车	27,900	199,485.00	0.06
48	002569	步森股份	14,928	197,497.44	0.06
49	000415	渤海租赁	20,600	157,384.00	0.05
50	600489	中金黄金	7,100	152,792.00	0.05
51	002443	金洲管道	19,300	123,906.00	0.04
52	600578	京能热电	15,100	120,951.00	0.04
53	002605	姚记扑克	5,200	110,240.00	0.04
54	002106	莱宝高科	4,800	96,336.00	0.03
55	002431	棕榈园林	3,280	84,591.20	0.03

56	601101	昊华能源	4,800	82,176.00	0.03
57	002371	七星电子	2,982	79,500.12	0.03
58	000733	振华科技	11,700	77,220.00	0.02
59	600559	老白干酒	2,700	77,058.00	0.02
60	002234	民和股份	6,772	75,846.40	0.02
61	000703	恒逸石化	4,400	73,172.00	0.02
62	000721	西安饮食	10,700	71,369.00	0.02
63	600547	山东黄金	2,100	68,964.00	0.02
64	002133	广宇集团	14,520	68,389.20	0.02
65	002231	奥维通信	7,600	65,436.00	0.02
66	002298	鑫龙电器	8,000	65,200.00	0.02
67	601008	连云港	17,160	65,036.40	0.02
68	600741	华域汽车	7,140	64,045.80	0.02
69	002195	海隆软件	4,000	64,040.00	0.02
70	002155	辰州矿业	3,080	59,628.80	0.02
71	600282	南钢股份	23,100	57,981.00	0.02
72	002052	同洲电子	5,860	57,135.00	0.02
73	002167	东方锆业	3,000	56,760.00	0.02
74	600794	保税科技	4,300	54,180.00	0.02
75	600897	厦门空港	4,054	54,120.90	0.02
76	600664	哈药股份	7,700	50,743.00	0.02
77	600739	辽宁成大	3,100	48,360.00	0.02
78	600546	山煤国际	2,174	45,480.08	0.01
79	601369	陕鼓动力	4,900	45,374.00	0.01
80	000789	江西水泥	3,200	41,696.00	0.01
81	600403	大有能源	2,000	41,140.00	0.01
82	002463	沪电股份	8,540	38,088.40	0.01
83	601233	桐昆股份	4,323	37,783.02	0.01
84	600375	华菱星马	3,800	37,506.00	0.01
85	000932	华菱钢铁	13,800	33,672.00	0.01
86	002546	新联电子	1,900	33,250.00	0.01
87	600160	巨化股份	3,040	30,704.00	0.01
88	002503	搜于特	947	21,591.60	0.01
89	002478	常宝股份	1,700	21,335.00	0.01
90	002369	卓翼科技	1,500	19,020.00	0.01
91	600804	鹏博士	2,120	12,592.80	0.00
92	002564	张化机	1,000	12,200.00	0.00
93	002527	新时达	800	11,080.00	0.00
94	600307	酒钢宏兴	3,000	10,410.00	0.00
95	000990	诚志股份	1,000	6,950.00	0.00
96	600320	振华重工	1,312	5,536.64	0.00

97	000596	古井贡酒	44	2,078.56	0.00
98	002311	海大集团	61	1,089.46	0.00
99	002014	永新股份	27	417.69	0.00
100	600565	迪马股份	40	195.20	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	600227	赤天化	5,926,043.49	3.49
2	000830	鲁西化工	5,527,104.00	3.26
3	600820	隧道股份	5,452,077.82	3.21
4	000563	陕国投 A	5,365,598.02	3.16
5	600004	白云机场	5,232,453.71	3.09
6	600157	永泰能源	5,171,270.40	3.05
7	600872	中炬高新	5,127,879.16	3.02
8	600880	博瑞传播	4,523,889.56	2.67
9	002008	大族激光	4,504,999.58	2.66
10	600584	长电科技	4,303,400.06	2.54
11	600104	上汽集团	4,228,124.89	2.49
12	600195	中牧股份	4,201,767.82	2.48
13	002062	宏润建设	4,099,515.39	2.42
14	600373	中文传媒	4,080,363.41	2.41
15	000799	酒鬼酒	4,056,549.97	2.39
16	002350	北京科锐	4,045,890.68	2.39
17	600748	上实发展	4,024,394.58	2.37
18	600435	北方导航	3,574,376.30	2.11
19	000157	中联重科	3,488,025.25	2.06
20	000975	科学城	3,413,151.44	2.01
21	600322	天房发展	3,398,920.12	2.00

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	000877	天山股份	5,425,076.08	3.20
2	600704	物产中大	4,112,170.90	2.42
3	600872	中炬高新	3,533,301.10	2.08

4	600741	华域汽车	3,440,829.99	2.03
5	600835	上海机电	3,349,468.06	1.97
6	000627	天茂集团	3,299,486.55	1.95
7	600290	华仪电气	3,091,236.48	1.82
8	002062	宏润建设	3,070,090.77	1.81
9	600755	厦门国贸	2,884,374.77	1.70
10	600409	三友化工	2,768,359.99	1.63
11	000799	酒鬼酒	2,752,280.59	1.62
12	600436	片仔癀	2,748,841.79	1.62
13	600196	复星医药	2,705,446.45	1.60
14	600325	华发股份	2,666,675.45	1.57
15	000970	中科三环	2,665,862.55	1.57
16	600022	山东钢铁	2,614,396.11	1.54
17	601000	唐山港	2,535,398.90	1.49
18	600160	巨化股份	2,503,487.76	1.48
19	002384	东山精密	2,469,089.58	1.46
20	600366	宁波韵升	2,408,399.53	1.42

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	415,936,629.93
卖出股票收入（成交）总额	287,757,177.33

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	应收证券清算款	—
3	应收股利	65,971.80
4	应收利息	3,859.22
5	应收申购款	188,548.83
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	258,379.85

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：本基金本报告期末积极投资前五名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(%)
5778	58,042.42	185,040,255.70	55.18	150,328,850.99	44.82

8.2 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	虞方定	4,028,296	52.15
2	金元证券股份有限公司	1,003,950	13.00
3	苏胜芬	458,607	5.94
4	莫春雷	258,981	3.35
5	曹新杰	200,050	2.59
6	张研	200,038	2.59
7	张志慧	199,350	2.58
8	金鸿章	148,026	1.92
9	张嘉堦	115,600	1.50
10	孙敏玲	96,700	1.25

8.3 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	240,433.07	0.0717

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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年10月12日)基金份额总额	455,487,249.88
报告期期初基金份额总额	199,861,533.26
本报告期基金总申购份额	273,454,173.38
减：本报告期基金总赎回份额	137,946,599.95
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	335,369,106.69

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 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 (%)	
东方证券	2	35,602,187.20	5.09	—	—	—	—	—	—	29,812.43	5.09	—
国海证券	2	73,587,521.48	10.51	—	—	—	—	—	—	61,915.85	10.56	—
国联证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	83,861,848.75	11.98	—	—	—	—	—	—	69,693.32	11.89	—
海通证券	1	64,654,961.29	9.24	—	—	—	—	—	—	52,532.34	8.96	—
宏源证券	2	11,814,975.97	1.69	—	—	—	—	—	—	9,666.01	1.65	—
华鑫证券	1	90,229,982.83	12.89	—	—	—	—	—	—	76,693.04	13.08	—
齐鲁证券	1	132,525,554.24	18.93	—	—	—	—	—	—	113,086.21	19.29	—
申银万国	2	63,970,849.12	9.14	—	—	—	—	—	—	54,415.86	9.28	—
兴业证券	2	143,798,274.38	20.54	—	—	—	—	—	—	118,301.15	20.18	—

注：1. 我公司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： 新增东方证券（上海 26055、深圳 391524）。

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04月28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中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的文件 2、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同 3、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）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、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）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： http://www.fullgoal.com.cn