

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

2011 年第 1 季度报告

2011 年 03 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

报告送出日期：2011 年 04 月 21 日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 30 日起至 2011 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	富国上证综指 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
报告期末基金份额总额 (单位:份)	133,138,513.00
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。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2011 年 01 月 30 日 (基金合同生效日)-2011 年 03 月 31 日)
1. 本期已实现收益	1,647,314.59
2. 本期利润	-809,375.36
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0073
4. 期末基金资产净值	388,788,347.42
5. 期末基金份额净值	2.920

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。

3.2 上证综指交易型开放式指数证券投资基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
自合同生效日至报告期末	-0.07%	0.56%	6.37%	1.00%	-6.44%	-0.44%

注：本基金合同于 2011 年 1 月 30 日生效，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。

3.2.2 自基金转型以来基金累计份额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 2011 年 3 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，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李笑薇	本基金基金经理兼任公司总经理助理、另类投资部总经理、富国沪深 300 增强证券投资基金、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	2011-01-30	-	9 年	博士，曾任摩根士丹利资本国际 Barra 公司 (MSCIBARRA)，BARRA 股票风险评估部高级研究员；巴克莱国际投资管理公司 (BarclaysGlobal Investors)，大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；2009 年 12 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理，2011 年 1 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经

	理				理；兼任富国基金公司总经理助理、另类投资部总经理；具有中国基金从业资格，美国国籍。
王保合	本基金基金经理兼任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	2011-03-03	-	6年	博士，曾任富国基金管理有限公司研究员；富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理；2011年3月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；具有基金从业资格，中国国籍。

注：本公司于2011年3月3日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告，增聘王保合先生担任本基金基金经理，与李笑薇女士共同管理本基金。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，严格执行交易系统内的公平交易程序，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 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

一季度 A 股市场整体表现为先抑后扬，前期在政府对房地产市场实施持续调整，以及投资者对货币政策由宽渐紧的担忧等多种因素的综合影响下，出现一定幅度的调整；后期，市场在银行股整体业绩超预期，以及大盘股估值修复的带动下，迎来一轮小幅上涨，上证指数达到前期高点 3000 点左右。整体来看，一季度上证综指上涨 5.67%，好于同期深成指和中小板指数分别为 1.93%和-5.45%的涨幅。

本报告期内，上证综指交易型开放式指数证券投资基金完成建仓，在建仓的过程中为避免市场冲击，以及净值大幅波动，采用逐步建仓策略。同时，完成综指 ETF 基金的上市，进入正常运作期。下季度将根据基金契约紧密跟踪标的指数，严格控制跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-0.07%，同期业绩比较基准收益率为 6.37%。

§ 5 上证综指交易型开放式指数证券投资基金投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	373,313,695.00	95.86
	其中：股票	373,313,695.00	95.86
2	固定收益投资	116,286.80	0.03
	其中：债券	116,286.80	0.03
	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	15,927,786.39	4.09
6	其他资产	65,665.82	0.02
7	合计	389,423,434.01	100.00

注：上表中的股票投资项的金额包含可退替代款估值增值，而 5.3 的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末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。

5.3 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	1,053,255.00	0.27
B	采掘业	84,495,719.00	21.73
C	制造业	90,647,294.00	23.32
C0	食品、饮料	10,449,484.00	2.69
C1	纺织、服装、皮毛	4,527,385.00	1.16
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,109,550.00	0.29
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,539,789.00	2.20
C5	电子	1,177,413.00	0.30
C6	金属、非金属	22,588,723.00	5.81
C7	机械、设备、仪表	29,987,978.00	7.71
C8	医药、生物制品	12,266,972.00	3.16
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	14,738,723.00	3.79
E	建筑业	7,747,838.00	1.99
F	交通运输、仓储业	21,687,027.00	5.58
G	信息技术业	12,024,094.00	3.09
H	批发和零售贸易	9,797,932.00	2.52
I	金融、保险业	104,589,717.00	26.90
J	房地产业	10,636,274.50	2.74
K	社会服务业	4,004,203.00	1.03
L	传播与文化产业	2,748,930.00	0.71
M	综合类	9,142,569.50	2.35
	合计	373,313,576.00	96.02

5.4 报告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

5.4.1 报告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前十名股票

票投资明细

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	3,172,400	37,751,560.00	9.71
2	601288	农业银行	6,170,000	17,029,200.00	4.38
3	601988	中国银行	4,305,800	14,338,314.00	3.69
4	600028	中国石化	1,220,500	10,410,865.00	2.68
5	601088	中国神华	333,200	9,692,788.00	2.49
6	601628	中国人寿	419,300	8,801,107.00	2.26
7	600036	招商银行	463,500	6,530,715.00	1.68

8	601318	中国平安	110,400	5,460,384.00	1.40
9	600000	浦发银行	374,100	5,095,242.00	1.31
10	601328	交通银行	860,100	4,893,969.00	1.26

5.4.2 报告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前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	可转债	116,286.80	0.03
7	其他	-	-
8	合计	116,286.80	0.03

5.6 报告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

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	110016	川投转债	980	116,286.80	0.03

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.8 报告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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.2 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。

5.9.3 报告期末其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	14,234.56
3	应收股利	46,314.00
4	应收利息	5,117.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,665.82

5.9.4 报告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。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.9.6 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。

§ 6 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
----------------------------	----------------

本报告期(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年03月31日)基金总申购份额	76,000,000.00
减:本报告期(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年03月31日)基金总赎回份额	52,500,000.00
本报告期(2011年01月30日(基金合同生效日)至2011年03月31日)基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-210,724,894.00
报告期期末基金份额总额	133,138,513.00

注:本基金于2011年1月30日合同生效,于2011年3月11日进行了份额折算,折算比例为0.34223209。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 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式指数证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、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
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

7.2 存放地点

上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5层

7.3 查阅方式

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>

富国基金管理有限公司 2011年04月21日