

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：2013年03月26日
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...

富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31日

投资资金：富国强收益定期开放债券型证券投资基金三只证券投资基金。

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Lists key personnel like 王石合 and 李英燕.

注：1、上述表格内基金经理的任职日期、离任日期均指公司决定并公告披露之日。
2、本公司于2012年5月24日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上公告，李英燕女士不再担任本基金基金经理，王保先生继续担任本基金基金经理。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期，富国基金管理有限公司作为富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人，严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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...

4.3 管理人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律法规要求，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、业绩评估和投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理...

4.3.2 公平交易制度的执行情况
本报告期，在双向交易价差分析方面，公司采取连续四个季度、不同时间窗口（日内、3日内、5日内）的日内双向交易价差分析，在双向交易价差为零及95%的置信水平下，对双向交易价差进行分布假设检验并出现异常结果...

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或成交少的单边交易超过约定证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人报告期内基金估值程序等事项的说明
4.4.1 报告期内基金估值程序分析
在基金估值管理上，我司坚持采取最优化策略进行指数跟踪和风险管理，虽然报告期内市场较大波动，我们的基金跟踪误差一直保持在较低水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2012年12月31日，本基金份额净值为0.81元，份额累计净值为0.813元。报告期内，本基金份额净值增长率为5.58%，同期业绩比较基准收益率为1.1%。

4.4.3 基金管理人及基金托管人
富国基金管理有限公司 基金管理人
中国工商银行股份有限公司 基金托管人

2.1 基金基本情况
基金名称：富国上证综指ETF联接
基金代码：110003
交易代码：110003
基金运作方式：契约型开放式

2.2 基金产品说明
基金简称：富国上证综指ETF联接
基金投资目标：通过主要投资于目标ETF，跟踪富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

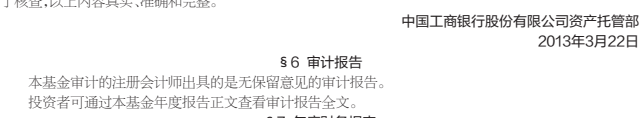
2.3 基金管理人及基金托管人
富国基金管理有限公司 基金管理人
中国工商银行股份有限公司 基金托管人

2.4 信息披露方式
基金年度报告全文的披露日期：2013年4月15日
基金年度报告全文的披露网站：www.fundgold.com.cn

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标

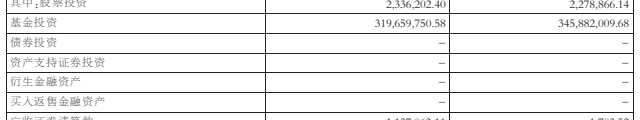
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），且管理费和其他收益水平要低于所列数字。

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



注：截止日期为2012年12月31日。
本基金合同于2011年4月30日生效，本基金建仓3个月，即从2011年1月30日起至2011年4月29日，建仓期期间各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 自基金成立以来基金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间计算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况

Table with columns: 年度, 期初基金份额, 期末基金份额, 期间基金份额变动, 年度利润分配合计, 备注.

4.1 基金管理人及基金基金经理
富国基金管理有限公司
富国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，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。

Table with columns: 项目, 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.1 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 期初余额, 本期新增, 本期减少, 期末余额.

7.2 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.4 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.5 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.6 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.7 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.8 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.9 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.10 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.11 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.12 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.13 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.14 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.15 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.16 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.17 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.18 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.19 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.20 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.21 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.22 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.23 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.24 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.25 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

7.26 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目: 本期, 上期, 上年同期. Financial summary table for 2012.

Table with columns: 序号, 基金名称, 基金类别, 运作方式, 管理人, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

注：我公司在基金资产净值的计算过程中综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金期间券商交易单元无变更。