(上接B62版)

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

（1）研究：指数投资研究小组依托公司整体研究平台,整合内部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展目标ETF的申购赎回清单分析、目标ETF流动性分析、标的指数成份证券相关信息的搜集与分析等,作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理的日常决策。

（3）交易执行：集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

（4）投资绩效评估：风险管理部门定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。

（5）组合监控与调整：基金经理将跟踪目标ETF申购赎回清单特征、二级市场交易特征、标的指数变动情况,并结合成份股基本面情况、成份股公司行为、流动性状况、本基金申购和赎回的现金流量以及组合投资绩效评估的结果等,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪业绩比较基准。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

九、基金的业绩比较基准

深证基本面120指数*95%＋银行同业存款利率*5%。

深证基本面120指数在深圳证券交易所上市公司中,以4个基本面指标来衡量上市公司的经济规模,并选取其中最大的120家A股上市公司作为样本,且样本个股的权重配置与其经济规模相适应。该指数不仅具有良好的基本面、市场代表性和流动性,且打破了样本股价格与其权重之间的联系,使得基本面经济规模大的股票可以获得较高的权重,并在一定程度上减少了高估股票在组合中权重过高的现象,因此可以为投资者提供另一个投资深圳市场的业绩比较基准和投资分析工具。

深证基本面120指数是本基金目标ETF的标的指数。如果目标ETF变更标的指数、或深证基本面120指数编制单位变更或停止深证基本面120指数的编制及发布、或深证基本面120指数由其他指数替代、或深证基本面120指数由于指数编制方法发生重大变更等原因导致深证基本面120指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分,本基金管理人可以依据审慎性原则,在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下,变更本基金的业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为深证基本面120ETF的联接基金，主要通过投资于深证基本面120ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的业绩表现与深证基本面120指数及深证基本面120ETF的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

基金管理人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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月15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。

本投资组合报告所载数据截至2013年12月31日（“报告期末”）,本报告所列财务数据未经审计。

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	6,429,031.64	3.10
	其中:股票	6,429,031.64	3.10
2	基金投资	189,286,653.88	91.18
3	固定收益投资	8,869.20	0.00
	其中:债券	8,869.20	0.00
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,637,934.08	5.61
7	其他资产	242,278.79	0.12
	合计	207,604,767.59	100.00

2、报告期末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	-	-
B	采矿业	231,978.00	0.11
C	制造业	4,048,129.64	1.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	135,947.00	0.07
E	建筑业	35,497.00	0.02
F	批发和零售业	498,494.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	81,493.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,125.00	0.01
J	金融业	660,260.00	0.32
K	房地产业	640,138.00	0.31
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	78,970.00	0.04
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,429,031.64	3.11

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000002	万科A	47,300	379,819.00	0.18
2	000651	格力电器	9,531	311,282.46	0.15
3	002024	苏宁云商	33,800	305,214.00	0.15
4	000001	平安银行	18,000	220,500.00	0.11
5	000333	美的集团	3,805	190,250.00	0.09
6	000100	TCL集团	74,500	173,585.00	0.08
7	000157	中联重科	31,000	168,950.00	0.08
8	000776	广发证券	13,000	162,240.00	0.08
9	000709	河北钢铁	77,700	155,400.00	0.08
10	000778	新兴铸管	22,400	142,688.00	0.07

4、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	中期票据	-	-
7	可转债	8,869.20	0.00
8	其他	-	-
	合计	8,869.20	0.00

5、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	127002	徐工转债	95	8,869.20	0.00

注:报告期末本基金仅持有上述1只债券。

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十名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

8、期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	嘉实深证基本面120ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	189,286,653.88	91.54

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

11、投资组合报告附注

（1）报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

（2）本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	121,252.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,420.44
5	应收申购款	116,829.72
6	其他应收款	1,776.60
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	242,278.79

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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	净值增长率①	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
2011年8月1日至2011年12月31日	-15.72%	1.03%	-24.92%	1.38%	9.20%	-0.35%
2012年	0.98%	1.29%	0.94%	1.32%	0.04%	-0.03%
2013年	-5.36%	1.35%	-5.96%	1.37%	0.60%	-0.02%

2、自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的变动比较

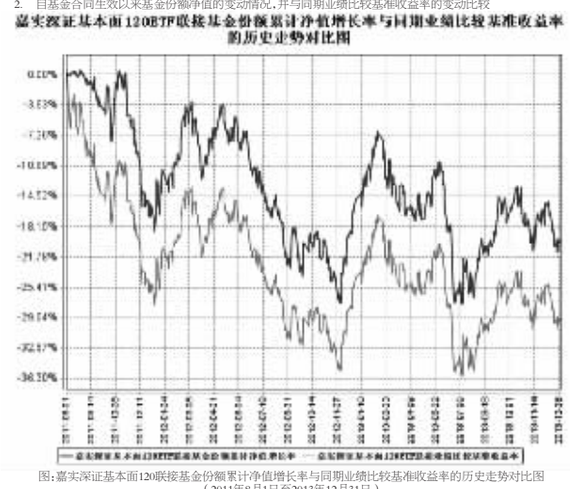


图:嘉实深证基本面120联接基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2011年8月1日至2013年12月31日）

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“十四、基金的投资（二）投资范围和（八）2、基金投资组合比例限制”的有关约定。

十三、费用概览

（一）基金费用的种类

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数,则取0）的0.5%年费率计提。计算方法如下:

H＝E×0.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后的剩余部分;若为负数,则E取0。

基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数,则取0）的0.1%年费率计提。计算方法如下:

H＝E×0.1%÷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扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后的剩余部分;若为负数,则取0。

基金托管费每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

（3）与基金运作有关的其他费用

主要包括因基金的证券交易或结算而产生的费用、基金合同生效以后的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效以后的会计师费和律师费、基金的资金汇划费用等。该等费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

（1）申购费

本基金申购费率按照申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

本基金申购费率最高不超过申购金额的5%,具体如下:

申购金额（含申购费）	申购费率
M<50万元	1.2%
50万元≤M<200万元	0.8%
200万元≤M<500万元	0.4%
M≥500万元	单笔1000元

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统和电话交易系统申购开放式基金业务实行申购费率优惠,其申购费率不按申购金额分档,统一优惠为申购金额的0.6%,但中国银行长城借记卡、招商银行借记卡持卡人申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行;机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购开放式基金业务,其申购费率不按申购金额分档,统一优惠为申购金额的0.6%。优惠后费率如果低于0.6%,则按0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于0.6%时,按实际费率收取申购费。

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金资产。

（2）赎回费

本基金的赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低。

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的5%,随持有期限的增加而递减。具体如下:

持有期限	赎回费率
<365天	0.50%
365天≤M<730天	0.25%
≥730天	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中25%的部分归入基金资产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

（3）转换费

基金转换费由基金份额持有人承担,用于支付有关手续费和注册登记费。本基金转换费率按照如下方式收取:

①嘉实货币市场基金、嘉实超短债证券投资基金、嘉实多元收益债券型证券投资基金B、嘉实安心货币市场基金转换为嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金赎回基金时,转换费率均为转入基金适用的申购费率,计算公式如下:

净转入金额＝（转出份额×转出当日转出基金的基金份额净值）/（1+转换费率）+M

转换费用＝（转出份额×转出当日转出基金的基金份额净值）×转换费率/（1+转换费率）

转入份额=净转入金额/转入当日转入基金的基金份额净值

其中M为嘉实货币市场基金、嘉实安心货币市场基金全部转出时账户当前累计未付收益

②嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金与嘉实旗下原有其他23只开放式基金（包括:嘉实成长收益证券投资基金、嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金、嘉实债券证券投资基金、嘉实服务增值行业证券投资基金、嘉实优质企业股票型证券投资基金、嘉实主题精选混合型证券投资基金、嘉实策略增长混合型证券投资基金、嘉实研究精选股票型证券投资基金、嘉实多元收益债券型证券投资基金A、嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金、嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金、嘉实价值优势股票型证券投资基金、嘉实稳固收益债券型证券投资基金、嘉实主题新动力股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、嘉实信用债券型证券投资基金、嘉实周期优选股票型证券投资基金、嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金、嘉实优化红利股票型证券投资基金、嘉实纯债债券型发起式证券投资基金A/C、嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金）之间互转,以及嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金转入嘉实货币市场基金、嘉实超短债证券投资基金、嘉实多元收益债券型证券投资基金B、嘉实安心货币市场基金时,均采用“赎回费＋申购费率补差”算法,计算公式如下:

净转入金额＝B×C×(1－D)/(1+G)

转换补差费用＝[B×C×(1－D)/(1+G)]×G

转入份额＝净转入金额/E

其中,B为转出的基金份额;

C为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D为转出基金的对应赎回费率;

G为对应的申购补差费率,当转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率时,则申购补差费率G为零;

E为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

其中赎回费的25%归入转出基金资产（嘉实稳固收益债券基金和嘉实纯债债券C除外）;根据嘉实稳固收益债券基金合同的约定,该基金的赎回费全部归入该基金资产（注:在运作期和间歇期,该基金按不同的方式收取赎回费）;根据嘉实纯债债券型发起式证券投资基金基金合同的约定,对于持有期限少于30日的C类基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产。

基金转换费由基金份额持有人承担。基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率，调整后的基金转换费率应及时公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易等）或在特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

注1:自2011年1月7日起嘉实增长混合暂停转入业务;自2011年1月7日起嘉实策略混合暂停转入业务;自2013年8月2日起,嘉实信用债券A、嘉实信用债券C单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过100万元;2014年1月9日起,嘉实研究精选股票暂停转换转入业务;2014年3月12日起,嘉实货币单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过100万元。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

注2:2013年4月9日,本基金管理人发布了《关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告》,自2013年4月12日起,在本公司基金网上直销系统（含电话交易）开通旗下部分基金产品的后端收费模式（包括申购、定期定额投资、基金转换等业务）,并对通过本公司基金网上直销系统（含电话交易）交易的后端收费进行费率优惠。本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

3、其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

（二）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失等不列入基金费用。

（三）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

（四）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况,对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下:

1. 在“重要提示”部分:明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2.在“三、基金管理人”部分:更新了基金管理人的相关信息。

3.在“四、基金托管人”部分:更新了基金托管人的相关信息。

4.在“五、相关服务机构”部分:增加嘉实财富、河北银行、数米基金、天天基金、长量基金五家代销机构,并更新相关销售机构和会计师事务所联系人信息。

5.在“八、基金份额的申购、赎回”部分:根据相关公告,增加了自2014年3月3日起降低投资者通过本公司网上直销办理首次投资金额、追加投资金额、赎回最低限额以及最低账面份额的单笔最低要求。

6.在“九、基金转换”部分:更新了基金转换的相关内容。

7.在“十二、基金的投资”部分:补充了本基金最近一期投资组合报告内容。

8.在“十三、基金的业绩”:基金业绩更新至2013年12月31日。

9.在“二十七、其他应披露事项”部分:列示了本基金自2013年8月1日至2014年2月1日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司
2014年3月15日

(上接B61版)

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	-	-
B	采矿业	22,274.00	0.01
C	制造业	85,339.60	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,076.24	0.00
E	建筑业	1,980.00	0.00
F	批发和零售业	7,806.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	24,336.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,654.00	0.00
J	金融业	13,002.00	0.00
K	房地产业	2,095.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	42,929.00	0.02
S	综合	28,842.00	0.01
	合计	251,333.84	0.10

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600551	时代出版	2,400	39,144.00	0.01
2	600398	凯诺科技	4,500	31,860.00	0.01
3	600256	广汇能源	3,300	28,842.00	0.01
4	600403	大有能源	2,400	17,088.00	0.01
5	600270	外运发展	1,600	16,304.00	0.01
6	600690	青岛海尔	800	15,600.00	0.01
7	601901	方正证券	2,200	13,002.00	0.00
8	600804	鹏博士	900	12,654.00	0.00
9	600775	南京熊猫	700	6,244.00	0.00
10	600575	芜湖港	1,800	5,832.00	0.00

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	中期票据	-	-
7	可转债	977.60	0.00
8	其他	-	-
9	合计	977.60	0.00

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	110024	隧道转债	10	977.60	0.00

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。

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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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。

（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。

10、投资组合报告附注

（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,本基金持有的大有能源于2013年10月23日公告其于2013年10月23日收到中国证券监督管理委员会（下称“中国证监会”）《调查通知书》（豫调查通字1359号）,因其公司涉嫌信息披露违法违规,故中国证监会对其立案调查。

本期，本基金持有的广汇能源于2013年7月20日公告其控股子公司新疆广汇新能源有限公司2013年7月18日收到哈密地区安全生产监督管理局《关于新疆广汇新能源有限公司“46”爆炸燃烧事故的处理决定》哈地安监管字[2013]95号,因其子公司“46”爆炸燃烧事故,受到哈密地区安全生产监督管理局行政处罚。

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8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。

（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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	22,744.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,016.58
5	应收申购款	49,712.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,474.01

（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）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601989	中国重工	16,272.00	0.01	筹划重大事项
2	600598	北大荒	3,340.00	0.00	重大资产重组

（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。

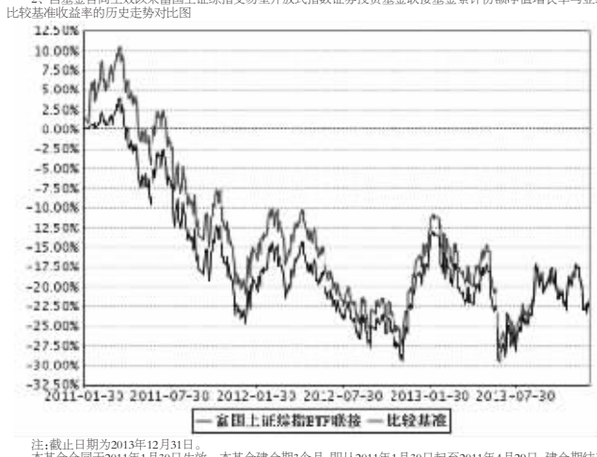
十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	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
2011.1.30-2011.12.31	-23.00%	1.01%	-19.13%	1.07%	-3.87%	-0.06%
2012.1.1-2012.12.31	5.58%	1.04%	3.10%	1.04%	2.48%	0.00%
2013.1.1-2013.12.31	-3.69%	1.13%	-6.34%	1.10%	2.65%	0.03%
2011.1.30-2013.12.31	-21.70%	1.06%	-21.90%	1.07%	0.20%	-0.01%

2、自基金合同生效以来富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:截止日期为2013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。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费;

（2）基金托管人的托管费;

（3）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

（4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

（5）基金份额持有人大会费用;

（6）基金的证券交易费用;

（7）基金的银行汇划费用;

（8）按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

2、本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

3、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

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

H＝MAX(E×0.5%÷当年天数,0)

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值扣除基金所持有目标ETF份额所对应的资产净值后的余额

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

（2）基金托管人的托管费

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

H＝MAX(E×0.1%÷当年天数,0)

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值扣除基金所持有目标ETF份额所对应的资产净值后的余额

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

上述“一、基金费用的种类”中第3－8项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

4、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

5、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用,投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

（1）前端收费模式

本基金前端收费模式对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体如下:

1）前端申购费率:

申购金额（单位:元）	前端申购费率
500万（含）以上	1000元/笔
大于等于100万,小于500万	0.70%
100万以下	1.50%

注:上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户外的其他选择前端收费模式的投资者。

2）特定申购费率:

购买金额（M,含申购费）	特定申购费率%）
M<100万	0.45
100万≤M<500万	0.21
500万≤M	每笔1000元

注:上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台、选择前端收费模式申购本基金的养老金客户,包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,具体包括:全国社会保障基金;可以投资基金的地方社会保障基金;企业年金单一计划以及集合计划;企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,本公司将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。

（2）后端收费模式

后端申购费率按基金份额的持有时间递减。具体如下:

持有时间	后端申购费率
1年以内（含）	1.6%
1年-3年（含）	1.0%
3年-5年（含）	0.5%
5年以上	0

本基金的后端收费模式目前仅适用于本公司基金直销系统,如有变更,详见届时公告或更新的招募说明书。实际办理过程中根据支付渠道不同可能存在限制办理后端申购模式的情况，具体以实际网上交易页面相关说明为准。

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费用

赎回费随基金持有时间的增加而递减,费率如下:

（1）前端收费模式

投资者赎回以前端收费模式申购的本基金份额时,费率如下:

持有时间	赎回费率
一年以内（含）-两年	0.50%
两年以上（含）	0.25%
两年以上（含）	0

（2）后端收费模式

投资者赎回以后端收费模式申购的本基金份额时,费率如下:

持有时间	赎回费率
2年以内（含）	0.6%
2年-3年（含）	0.3%
3年以上	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中25%的部分归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

3、转换费用

（1）前端转前端

基金转换费用由转出基金的赎回费和转出和转入基金的申购费补差两部分构成,具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。其中:转出基金赎回费是按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用;转入基金申购补差费是按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。对于前端转前端模式,转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的,补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额;转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的,补差费为零。基金转换的计算公式如下:

转出基金赎回费＝转出金额×转出基金赎回费率

转入金额＝转出金额－转出基金赎回费

净转入金额＝转入金额÷（1＋申购补差费率）

申购补差费＝转入金额－净转入金额

转入份额＝净转入金额÷转入基金当日之基金份额净值

注:转换份额的计算结果保留到小数点后2位。如转出基金为货币基金,且全部份额转出账户时,则净转入金额应加上转出货币基金的当前累计未付收益。

（2）后端转后端

后端收费模式基金发生转换时,其转换费由转出基金的赎回费和申购补差费两部分构成,其中申购补差费率按照转入基金与转出基金的后端申购费率的差额计算。当转出基金后端申购费率高于转入基金后端申购费率时,基金转换申购费补差费率为转出基金与转入基金申购费率之差;当转出基金的后端申购费率低于转入基金的后端申购费率,申购补差费率为零。

1）对于由中国证券登记结算有限责任公司担任注册登记机构的基金,其后端收费模式下份额之间互相转换的计算公式如下:

转出金额=转出份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金赎回费用=转出金额×转出基金赎回费率

申购补差费用=（转出金额-转出基金赎回费用）×补差费率

净转入金额=转出金额-转出基金赎回费用-申购补差费用

转入份额=净转入金额/转换申请当日转入基金的基金份额净值

2）对于由本公司担任注册登记机构的基金,后端收费模式下基金份额之间互相转换的计算公式如下:

转出金额=转出份额×转