

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：2013年08月29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，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。本基金年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并报中国证监会备案。

基金管理人：中国农业银行股份有限公司，住所：北京市东城区建国门内大街22号，法定代表人：蒋超，基金托管人：富国基金管理有限公司，住所：北京市朝阳区南湖东园1号，法定代表人：陈志列。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。

本年度报告摘要根据半年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中财务资料未经审计。

1.2 基金简介

1.2.1 基金基本情况

基金简称：富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2013年06月30日

单位：人民币元

资产：9,936,777.65 上年度末(2012年12月31日)

银行存款 9,936,777.65 18,743,972.64

结算备付金 648,211.32 621,016.23

存出保证金 110,719.26 -

交易性金融资产 174,516,176.65 343,405,470.22

其中：股票投资 174,514,276.37 343,403,770.22

基金投资 - -

债券投资 1,900.28 1,700.00

资产支持证券投资 - -

衍生金融资产 - -

买入返售金融资产 343,320.58 1,277,300.81

应收证券清算款 3,894.91 4,128.22

应收利息 120,811.20 -

应收股利 283,519.25 296,800.11

递延所得税资产 - -

其他资产 - -

资产总计 185,963,426.86 364,348,688.23

负债和所有者权益(2013年06月30日)

负债： 上年度末(2012年12月31日)

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付交易费用 343,320.58 1,277,300.81

应付证券清算款 3,894.91 4,128.22

应付利息 120,811.20 -

应付股利 283,519.25 296,800.11

应付赎回费 - -

应付申购款 - -

应付交易费用 63,811.13 703,881.84

应付管理人报酬 210,100.71 280,148.95

应付托管费 31,515.09 42,022.33

应付交易费用 - -

应付税费 464,134.97 319,948.16

应付交易费用 - -

应付税费 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付申购款 - -

应付赎回费 - -

应付交易费用 204,193,700.24 396,283,949.51

应付管理人报酬 19,240,594.23 33,683,915.19

应付托管费 184,953,106.01 362,600,034.32

应付交易费用 185,963,426.86 364,348,688.23

2.3 基金费用和收入分配

2.3.1 主要会计数据和财务指标

报告期(2013年01月01日至2013年06月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.0942

期末基金资产净值 184,953,106.01

期末基金份额净值 0.906

本期可供分配利润指持有人在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、基金管理费等)计算

费用后实现的可供分配利润。

本期实现的可供分配利润指基金收入，投资人收益，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可供分配利润减去本期公允价值变动收益。

2.3.2 基金净值表现

2.3.2.1 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.2 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.3 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.4 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.5 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.6 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.7 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.8 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.9 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.10 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.11 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.12 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.13 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.14 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.15 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.16 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.17 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.18 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.19 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.20 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.21 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.22 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.23 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.24 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.25 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.26 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.27 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.28 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.29 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.30 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.31 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.32 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.33 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.34 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.35 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.36 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.37 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.38 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.39 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.40 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.41 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.42 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.43 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.44 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.45 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.46 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.47 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.48 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.49 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.50 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.51 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.52 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.53 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.54 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.55 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.56 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.57 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.58 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.59 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.60 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.61 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.62 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.63 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.64 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.65 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.66 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.67 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.68 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.69 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.70 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.71 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.72 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.73 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.74 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.75 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3.2.76 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2