

## 富国沪深 300 增强（指数增强型）

### 业绩评价

截止日期：2012-6-30

| 类别         | 今年以来  | 近 3 月  | 近 6 月 | 近 1 年  | 近 2 年 |
|------------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 总回报        | 8.68  | 2.28   | 8.68  | -13.78 | 9.24  |
| 超越指数（上证综指） | 7.50  | 3.93   | 7.50  | 5.65   | 16.45 |
| 同类排名       | 5/142 | 22/145 | 5/142 | 20/114 | 1/67  |

### 超额收益

| 类别             | 近 3 月  | 近 6 月 | 近 1 年 | 近 2 年 |
|----------------|--------|-------|-------|-------|
| 超额收益（与业绩比较基准比） | 1.63   | 3.16  | 3.17  | 9.86  |
| 指数基金同类排名       | 17/142 | 1/132 | 3/100 | 2/57  |

### 业绩走势

截止日期：2012-6-30



### 基金经理 李笑薇

**李笑薇：**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，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；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。

### 历史管理业绩

截止日期 2012-07-20

| 名称         | 基金公司 | 投资风格 | 任职起始日      | 任职截止日     | 净值增长率(%) | 排名      |
|------------|------|------|------------|-----------|----------|---------|
| 富国中证 500   | 富国   | 股票型  | 2011-10-12 | -         | -8.30    | 102/143 |
| 富国上证综指联接   | 富国   | 股票型  | 2011-01-30 | 2012-5-24 | -17.80   | 81/98   |
| 富国上证综指 ETF | 富国   | 股票型  | 2011-01-30 | 2012-5-24 | -18.58   | 83/98   |
| 富国沪深 300   | 富国   | 股票型  | 2009-12-23 | -         | -15.86   | 2/45    |

### 基金公司

富国基金公司设立于 1999 年 4 月 13 日，有 28 只基金，产品线完善，涵盖各种类型和风险属性的基金产品。最新规模 711.60 亿元，在基金公司中规模排名第 9 位。目前股票管理能力评级为★★★★★。截至 2012 年 6 月 30 日，股票管理业绩如下：

| 名称   | 最新星级  | 最近一年排名 | 最近两年排名 | 最近三年排名 |
|------|-------|--------|--------|--------|
| 富国基金 | ★★★★★ | 21/61  | 5/60   | 6/60   |

### 基本信息

|                  |                     |                            |          |
|------------------|---------------------|----------------------------|----------|
| 单位净值（2012-7-20）： | 0.8380              | 资产规模（2012-6-30）：           | 60.87 亿元 |
| 累计净值（2012-7-20）： | 0.8380              | 海通风险评价：                    | 高风险      |
| 成立日期：            | 2009-12-16          | 海通分类：                      | 指数型      |
| 基金管理人：           | 富国基金                | 股票投资范围：                    | 90%-95%  |
| 客服电话：            | 400-888-0688        | 沪深 300 指数成分股投资范围           | 80%以上    |
| 公司网站：            | www.fullgoal.com.cn | 业绩基准：沪深 300 收益率×95% + 1.5% |          |

### 产品概述

该基金属于增强型指数基金，采用被动复制指数和主动增强双重策略，在对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，再通过量化方法优化组合，力争获得超越沪深 300 的收益。该基金始终保持较高仓位，属于风险较高的基金品种，适合风险承受能力较强的投资者。

### 产品特点

**收益较优 持续超越上证指数收益：**基金长、中、短期收益都处在同类基金的中上游水平内，长期业绩表现出色，近两年收益居指数基金之首，且持续超越上证指数收益。

**增强策略贡献正收益 持续超越标的指数收益：**将沪深 300 指数作为标的指数的基金超过 20 只，但能够持续获得超越指数收益的基金寥寥无几，富国沪深 300 通过有效的增强策略获得了显著的超额收益，今年以来超额收益排名居首，近 1 年、2 年超额收益稳居同类前列。

**指数化投资优势显著：**富国沪深 300 相比于主动投资基金，具备高仓位运作最大限度博取市场收益、分散投资分散风险、费率较低、投资操作透明等优势，尤其适合市场走势有一定判断能力但缺乏个股选择能力的投资者。

**标的指数具备一定投资价值：**作为被动投资产品，指数基金的表现主要取决于标的指数，富国沪深 300 标的指数是我国最具影响力的指数之一，其市场代表性良好，横跨我国沪深两市，样本覆盖了沪深市场六成左右市值；指数行业分布上偏重金融，除金融行业外，其他行业分布则较为均衡；历史收益持续超越上证指数，从 2005 年至 2012 年 7 月 20 日，沪深 300 获得了 139.85% 的收益，而同期上证指数仅上涨了 71.23%。

**多样化投资策略：**指数基金作为一种投资工具既适合长期持有获得市场成长收益也适合用作短期博取波段收益的工具。同时，由于沪深 300 股指期货的存在，该基金还可以用作构建套利组合等。

### 十大股票

2012-6-30

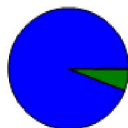
| 股票名称 | 所属行业     | 持有基金数量 | 占净资产比例(%) | 近期涨跌幅(%) |
|------|----------|--------|-----------|----------|
| 中国平安 | 金融、保险业   | 197    | 4.44      | 1.06     |
| 民生银行 | 金融、保险业   | 94     | 3.96      | -1.17    |
| 兴业银行 | 金融、保险业   | 98     | 3.25      | -6.16    |
| 浦发银行 | 金融、保险业   | 80     | 3.07      | -6.40    |
| 招商银行 | 金融、保险业   | 91     | 2.93      | -8.52    |
| 中信证券 | 金融、保险业   | 113    | 2.52      | 1.50     |
| 中国神华 | 采掘业      | 46     | 2.34      | -1.02    |
| 中国建筑 | 建筑业      | 22     | 2.34      | -3.29    |
| 中联重科 | 机械、设备、仪表 | 46     | 2.19      | -6.68    |
| 万科 A | 房地产业     | 135    | 2.06      | 5.89     |

注：十大股票和十大行业近期涨跌幅统计时间为 7 月以来的涨跌幅（2012-7-1 至 2012-7-20）

### 大类资产配置

2012-6-30

| 分类 | 本期比例  | 上期比例  | 变动    |
|----|-------|-------|-------|
| 股票 | 94.11 | 94.65 | -0.54 |
| 债券 | 0.00  | 0.00  | 0.00  |
| 现金 | 5.64  | 5.90  | -0.26 |
| 其他 | 0.45  | 1.04  | -0.59 |



股票  
债券  
银行存款  
其它资产

### 十大行业分布

2012-6-30

| 类别       | 比例(%) | 近期涨跌幅(%) |
|----------|-------|----------|
| 金融、保险业   | 26.21 | -2.36    |
| 机械、设备、仪表 | 13.72 | -5.93    |
| 采掘业      | 9.39  | -0.44    |
| 食品、饮料    | 7.15  | 2.00     |
| 金属、非金属   | 6.90  | -3.58    |
| 批发和零售贸易  | 6.09  | -4.23    |
| 房地产业     | 4.62  | -2.54    |
| 建筑业      | 4.31  | -1.61    |
| 医药、生物制品  | 3.69  | 0.94     |
| 电子       | 3.19  | -4.16    |

### 费率结构（前端申购费）

| 标准公告费率 | 富国网站优惠费率          |
|--------|-------------------|
| 1.2%   | 0.6%-0.96%        |
| 0.8%   | 0.6%-0.64%        |
| 1000 元 | 1000 元            |
|        | X<100 万元          |
|        | 100 万元<=X<1000 万元 |
|        | X>=500 万元         |
| 赎回费    | 0.50%             |