

## 富国天益价值证券投资基金

## 2012 半年度报告摘要

度情况。

4.3.2 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。

公司旗下管理证券投资基金在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面,未出现成交

较少或成交交易数量超过该证券当日成交量5%的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

4.4 管理人对于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

2012年上半年A股市场整体呈现先涨后跌走势,但机会与风险并存,结构性特征明显。

在宏观经济形势持续下滑的大背景下,投资者对中国经济前景愈加悲观,周期性行业跌幅

明显,市场前期经过调整的稳增长行业青睞有加。本基金上半年在保持既往投资风

格的同时,采取了相对稳健的投资策略,配置相对均衡,总体效果并不理想。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日,本基金份额净值为0.8336元,份额累计净值为3.8449元。报告期

内,本基金份额净值增长率为34.34%,同期业绩比较基准收益率为4.60%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年本基金将保持乐观态度应对市场变化,加大组合调整力度,在积极寻找结构性

投资机会的同时,做好风险控制。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会,并制订了《富国基金管理有限公

司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机构,由主管运营

助理负责,成员包括基金清算、监察稽核、金融工程及估值方面的业务骨干以及相关基金经

理,所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意

见,并提供估值技术、执行估值决策和程序,对外信息披露等工作,保证基金估值的公允性

和合理性,维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员,必须列席估值委

员会的定期会议,提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题,参与估值程序和估值

的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

4.7.1 报告期内基金进行利润分配

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

5 投资者服务

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012年上半年,本基金托管人在富国天益价值证券投资基金的托管过程中,严格遵守了

《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人

应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的

说明

2012年上半年度,富国基金管理有限公司在富国天益价值证券投资基金投资运作、基

金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现

损害基金持有人的利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

2012年上半年度,由富国基金管理有限公司聘请并经托管人复核审查的有关富国天

益价值证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相

关内容,投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富国天益价值证券投资基金

报告截止日:2012年06月30日

单位:人民币元

资产

本期末

上年度末

(2012年06月30日)

(2011年12月31日)

资产:

银行存款

443,347,689.67

35,443,892.18

结算备付金

178,816,602.19

139,259,112.33

交易保证金

1,801,545.65

1,109,994.32

存出投资款

7,568,838,758.89

7,512,503,680.97

其中:股票投资

7,018,932,249.49

6,807,076,971.57

基金投资

-

-

债券投资

-

-

资产支持证券投资

349,906,509.40

705,426,709.40

衍生金融资产

-

-

买入返售金融资产

529,918,494.88

397,500,616.25

应收证券清算款

-

-

应收利息

8,370,642.12

12,475,694.58

应收股利

3,324,507.83

-

应收申购款

980,770.13

974,899.84

递延所得税资产

-

-

其他资产

-

-

资产总计

8,535,399,011.36

8,154,910,173.77

负债和所有者权益

本期末

上年度末

(2012年06月30日)

(2011年12月31日)

负

债:

短期借款

-

-

交易性金融负债

-

-

衍生金融负债

-

-

卖出回购金融资产款

-

-

应付证券清算款

282,009,266.35

2,221,141.46

应付赎回款

4,453,715.20

-

应付管理人报酬

10,373,386.20

10,745,143.23

应付托管费

1,728,897.74

1,790,857.24

应付销售服务费

-

-

应付交易费用

1,701,943.10

2,615,260.07

应付利息

776,180.80

776,180.80

应付股利

-

-

递延所得税负债

-

-

其他负债

714,954.47

960,831.87

负债合计

301,758,343.86

19,109,414.67

所有者权益:

实收基金

9,876,873,766.59

10,184,339,922.30

未分配利润

-1,643,233,099.09

-2,048,539,163.20

所有者权益合计

8,233,640,667.50

8,135,800,759.10

负债和所有者权益总计

8,535,399,011.36

8,154,910,173.77

注:报告截止日2012年06月30日,基金份额净值0.8336元,基金份额总额9,876,873,766.59份。

6.2 利润表

会计主体:富国天益价值证券投资基金

本报告期:2012年01月01日至2012年06月30日

单位:人民币元

项目

本期

上期

(2012年01月01日至2012年06月30日)

(2011年01月01日至2011年06月30日)

一、收入

448,179,160.67

-83,213,603.24

1.利息收入

14,895,942.60

8,897,089.10

其中:存款利息收入

2,389,652.87

1,178,873.21

债券利息收入

9,570,585.55

6,251,622.07

资产支持证券投资收入

-

-

买入返售金融资产收入

2,935,704.18

1,466,593.82

其他利息收入

-

-

2.投资收益(损失以“-”填列)

43,267,762.83

327,206,416.37

其中:股票投资收益

-28,203,862.34

265,563,874.95

基金投资收益

-

-

债券投资收益

-2,367,970.00

9,341,940.12

资产支持证券投资收益

-

-

衍生工具投资收益

73,839,595.17

52,300,601.30

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)

389,820,318.37

-419,444,720.20

4.汇兑收益(损失以“-”号填列)

-

-

5.其他收入(损失以“-”号填列)

195,136.87

127,611.49

减:二、费用

80,738,323.44

96,401,264.00

1.管理人报酬

62,613,686.41

77,180,921.72

2.托管费

10,435,614.49

12,863,487.07

3.销售服务费

-

-

4.交易费用

7,460,874.77

5,462,804.84

5.利息支出

4,277.88

669,588.62

其中:卖出回购金融资产支出

-

-

6.其他费用

223,869.91

224,461.52

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)

367,440,837.23

-179,614,867.24

减:所得税费用

-

-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)

367,440,837.23

-179,614,867.24

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富国天益价值证券投资基金

本报告期:2012年01月01日至2012年06月30日

单位:人民币元

项目

本期

上期

(2012年01月01日至2012年06月30日)

(2011年01月01日至2011年06月30日)

一、期初所有者权益(基金净值)

10,184,339,922.30

-2,048,539,163.20

8,135,800,759.10

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

-367,440,837.23

367,440,837.23

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(基金净值减少以“-”号填列)

-307,466,155.71

37,865,226.88

-269,600,928.83

其中:1.基金申购款

311,585,804.95

-54,633,265.13

256,952,539.82

2.基金赎回款

-619,051,960.66

92,498,492.01

-526,553,468.65

三、本期基金份额持有人分利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)

-

-

五、期末所有者权益(基金净值)

9,876,873,766.59

-1,643,233,099.09

8,233,640,667.50

项目

本期

上期

(2012年01月01日至2012年06月30日)

(2011年01月01日至2011年06月30日)

一、期初所有者权益(基金净值)

10,511,385,949.68

14,227,660.73

10,661,108,614.24

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

-

-

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(基金净值减少以“-”号