富国天益价值证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

基金管理人:	富国基金管理有限公司
基金托管人:	交通银行股份有限公司
送出日期:	2013年08月29日

§1 重要提示及目录

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司(简称:交通银行)根据本基金合同规定,于2013年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国天益价值股票
基金主代码	100020
交易代码	前端交易代码:100020 后端交易代码:100021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年06月15日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,672,508,187.72份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属价值型基金,主要投资于内在价值被低估的上市公司的股票,或与同类型上市公司相比具有更高相对价值的上市公司的股票。本基金通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险,在注重基金资产安全的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取积极的投资策略。本基金在大类资产配置和行业配置层面,遵循自上而下的积极策略,个股选择层面,遵循自下而上的积极策略。根据基金经理对股票市场变动的趋势的判断,决定基金资产在股票、债券、现金等金融资产上的分布,并进行动态配比以规避系统性风险的影响,最大限度地确保基金资产的安全。
业绩比较基准	95%的中信标普300指数+5%的中信国债指数
风险收益特征	本基金为价值型证券投资基金,属于证券投资基金中的中低风险品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	裴学敏
	联系电话	021-20361818	95559
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	peixm@bankcomm.com
客户服务电话		95105686,4008880688	95559
传真		021-20361616	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层 交通银行 上海市浦东新区银城中路188号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期(2013年01月01日至2013年06月30日)
本期已实现收益	263,228,072.94
本期利润	-244,961,679.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0260
本期基金份额净值增长率	-3.88%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2013年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1867
期末基金资产净值	7,053,301,163.71
期末基金份额净值	0.8133

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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、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收益加上本期公允价值变动收益。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-10.54%	1.44%	-14.34%	1.75%	3.80%	-0.31%
过去三个月	-5.73%	1.22%	-10.66%	1.35%	4.93%	-0.13%
过去六个月	-3.88%	1.29%	-11.08%	1.39%	7.20%	-0.10%
过去一年	-2.44%	1.11%	-8.89%	1.27%	6.45%	-0.16%
过去三年	3.00%	1.16%	-12.48%	1.28%	15.48%	-0.12%
自基金合同生效日起至今	408.19%	1.39%	116.42%	1.72%	291.77%	-0.33%

注:本基金合同于2004年6月15日生效。

根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金的业绩比较基准=95%的中信标普300指数+5%的中信国债指数。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中信标普300指数,债券投资部分的业绩比较基准采用中信国债指数。中信标普300指数由深沪两市具有行业代表性的公司构成,样本股经过流动性和财务稳定性的审慎检查,能较全面地描述中国A股市场地总体趋势。中信标普国债指数反映了交易所国债整体走势,是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,1日收益率(benchmarkt)按下列公式计算:

benchmarkt =95% * [中信标普300指数t/(中信标普300指数t-1)-1] +5% * [中信国债指数t/(中信国债指数t-1)-1];

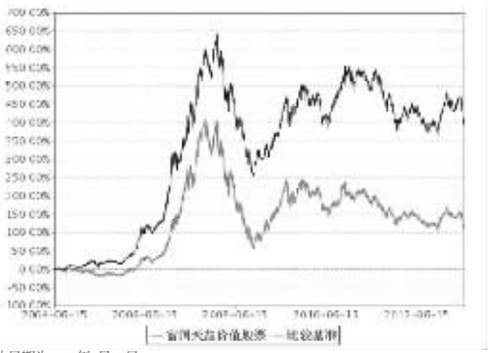
其中,t=1,2,3,…,T,T表示时间截至日;

期间T日收益率(benchmarkT)按下列公式计算:

benchmarkT = [∏Tt=1 (1+benchmarkt)]-1

其中,T=2,3,4,…;∏Tt=1 (1+benchmarkt)表示t日至T日的(1+benchmarkt)数学连乘。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:截止日期为2013年6月30日。

本基金于2004年6月15日成立,建仓期6个月,从2004年6月15日至2004年12月14日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。本基金于2007年11月6日大比例分红规模急剧扩大,建仓期3个月,从2007年11月5日至2008年2月4日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1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成立,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。截止2013年6月30日,本基金管理人共管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、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、富国天盈分级债券型证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、富国产业债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业股票型证券投资基金、富国中国中小盘(香港上市)股票型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强收益定期开放债券型证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国信用增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金三十七只证券投资基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈戈	本基金基金经理、基金管理公司副总经理	2005-04-13	-	17年	硕士,曾任国泰君安证券有限责任公司研究所研究员;2000年10月任富国基金管理有限公司研究员、行业研究主管、研究策划部经理、总经理助理。2005年4月至今任富国天益基金经理,兼任公司副总经理。具有基金从业资格,中国国籍。

注:上述表格内基金经理的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。

证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对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天益价值证券投资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》、《富国天益价值证券投资基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以尽可能减少和分散投资风险,力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,管理和运用基金资产,无损害基金持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求,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、业绩评估等投资管理环节,实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括:1、一级市场,通过标准化的办公流程,对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制;2、二级市场,通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理,对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制、银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为,非经特别控制流程审核同意,不得进行;对于同日同向交易,通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合,对同一投资标的采用相同投资策略的,必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令,确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估,以及不同时间窗口下(1日、3日、5日)的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统,对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估,分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品,并重点分析同类组合(股票型、混合型、债券型)间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为,若发现异常交易行为,监察稽核部视情况要求相关当事人做出合理性解释,并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字,并经督察长、总经理审阅签字后,归档保存,以备后查。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

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,因组合流动性管理或投资策略调整需要,出现53次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对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

2013年上半年A股市场指数总体萎靡不振,但以创业板为代表的小市值公司和科技类行业表现抢眼,出于对中国经济增速持续下降的担忧,投资者纷纷远离传统行业,转而追捧看似与经济走势相关性不大的新兴产业。本基金在二季度坚持既定投资策略,没有追逐市场热点,整体净值表现不佳。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.8133元,份额累计净值为3.8246元。报告期内,本基金份额净值增长率为-3.88%,同期业绩比较基准收益率为-11.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,本基金仍然对中国经济的长远前景持乐观态度,短期的增速下滑有利于实体经济休养生息和加速企业的优胜劣汰。下半年本基金将坚持积极操作,专注于投资有望在竞争中最终胜出的优质企业,争取为投资者创造更优秀的投资回报。

4.6 管理人对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关,由主管运营副总经理负责,成员包括基金清算、监察稽核、金融工程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基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、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技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配。

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2013年上半年度,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

2013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、基金资产净值的计算、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的真实、准确和完整发表意见

2013年上半年度,由富国基金管理有限公司编制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:2013年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末(2013年06月30日)	上年度末(2012年12月31日)
资产:		
银行存款	8,421,460.89	376,136,014.14
结算备付金	25,892,621.52	18,812,399.38
存出保证金	1,786,688.53	1,523,789.92
交易性金融资产	6,784,393,002.52	8,061,262,343.91
其中:股票投资	6,219,910,866.22	7,245,232,266.51
基金投资	-	-
债券投资	564,482,136.30	816,030,077.40
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	246,000,569.00	131,560,345.84
应收证券清算款	19,264,629.51	40,752,821.37
应收利息	7,655,973.30	11,126,221.99
应收股利	2,591,184.76	-
应收申购款	689,586.08	1,112,707.74
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,096,695,716.11	8,642,286,644.29
负债和所有者权益	本期末(2013年06月30日)	上年度末(2012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	25,753,767.15	111,106,233.03
应付赎回款	2,710,705.01	5,238,728.93
应付管理人报酬	9,175,228.24	10,164,771.25
应付托管费	1,529,204.70	1,694,128.56
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,229,921.02	2,819,688.54
应交税费	776,180.80	776,180.80
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	219,545.48	929,127.02
负债合计	43,394,552.40	132,728,858.13
所有者权益:		
实收基金	8,672,508,187.72	10,056,919,250.94
未分配利润	-1,619,207,024.01	-1,547,361,464.78
所有者权益合计	7,053,301,163.71	8,509,557,786.16
负债和所有者权益总计	7,096,695,716.11	8,642,286,644.29

注:报告截止日2013年06月30日,基金份额净值0.8133元,基金份额总额8,672,508,187.72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:2013年01月01日至2013年06月30日

单位:人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年06月30日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年06月30日)
一、收入	-159,705,568.50	448,179,160.67
1.利息收入	11,324,402.83	14,895,942.60
其中:存款利息收入	1,317,472.42	2,389,652.87
债券利息收入	6,930,900.95	9,570,585.55
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,076,029.46	2,935,704.18
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	336,688,612.94	43,267,762.83
其中:股票投资收益	273,651,205.25	-28,203,862.34
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,050,920.60	-2,367,970.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	65,088,328.29	73,839,595.17
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-508,189,752.57	389,820,318.37
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	471,168.30	195,136.87
减:二、费用	85,256,111.13	80,738,323.44
1.管理人报酬	61,559,591.21	62,613,686.41
2.托管费	10,259,931.87	10,435,614.49
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	13,226,361.12	7,460,874.77
5.利息支出	-	4,277.86
其中:卖出回购金融资产支出	-	4,277.86
6.其他费用	210,226.93	223,869.91
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-244,961,679.63	367,440,837.23
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-244,961,679.63	367,440,837.23

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:2013年01月01日至2013年06月30日

单位:人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	10,056,919,250.94	-1,547,361,464.78	8,509,557,786.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-244,961,679.63	-244,961,679.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,384,411,063.22	173,116,120.40	-1,211,294,942.82
其中:1.基金申购款	233,797,191.40	-26,842,985.12	206,954,206.28
2.基金赎回款	-1,618,208,254.62	199,959,105.52	-1,418,249,149.10
四、本期向基金份额持有人分配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)	8,672,508,187.72	-1,619,207,024.01	7,053,301,163.71
项目	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
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、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(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
四、本期向基金份额持有人分配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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

陈敏 林志松 雷青松

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国天益价值证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2004]38号文《关于同意富国天益价值证券投资基金设立的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2004年6月15日正式生效,首次设立募集规模为1,033,718,023.69份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括投资于国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金属价值型基金,主要投资于内在价值被低估的上市公司的股票,或与同类型上市公司相比具有更高相对价值的上市公司的股票。本基金原则上的资产配置比例为:股票最高可达到基金资产净值的95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为:95%×中信标普300指数+5%×中信国债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2013年6月30日的财务状况以及自2013年1月1日至2013年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,对于证券投资基金通过公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司("海通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司("申银万国")	基金管理人的股东、基金代销机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期(2013年01月01日至2013年06月30日)		上年度可比期间(2012年01月01日至2012年06月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	260,514,846.25	3.07	458,440,185.34	9.44
申银万国	809,504,670.57	9.55	1,061,747,074.40	21.86

6.4.8.1.2 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期(2013年01月01日至2013年06月30日)		上年度可比期间(2012年01月01日至2012年06月30日)	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
海通证券	4,844,971.60	76.15	-	-

6.4.8.1.4 回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期(2013年01月01日至2013年06月30日)		上年度可比期间(2012年01月01日至2012年06月30日)	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
海通证券	652,000,000.00	5.12	621,000,000.00	10.90
申银万国	-	-	185,000,000.00	3.25

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期(2013年01月01日至2013年06月30日)			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
海通证券	237,173.42	3.11	54,268.34	1.68
申银万国	719,045.75	9.44	251,850.45	7.80
关联方名称	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年06月30日)			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
海通证券	391,879.38	9.65	113,404.90	6.67
申银万国	875,300.97	21.55	300,725.87	17.70

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年06月30日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年06月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	61,559,591.21	62,613,686.41
其中:支付销售机构的客户维护费	12,265,266.06	12,486,883.50

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年06月30日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	10,259,931.87	10,435,614.49

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未发生关联方银行间债券(含回购)的交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本报告期末及上年度可比期间末本基金除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期(2013年01月01日至2013年06月30日)		上年度可比期间(2012年01月01日至2012年06月30日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	8,421,460.89	388,547.79	443,347,689.67	999,501.03

注:本基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户的证券交易结算资金余额2013年上半年末为25,892,621.52元,2012年上半年末为178,816,602.19元。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本报告期内及上年度可比期间内本基金均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.9 期末(2013年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:截至本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	
601989	中国重工	2013-05-17	筹划重大事项	4.52	-	-	40,504,946	223,703,306.76	183,082,355.92	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注:截至本报告期末,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额;没有因正回购而作为抵押的银行间市场债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额;没有因交易所市场债券正回购而作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,219,910,866.22	87.65
	其中:股票	6,219,910,866.22	87.65
2	固定收益投资	564,482,136.30	7.95
	其中:债券	564,482,136.30	7.95
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	246,000,569.00	3.47
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	34,314,082.41	0.48
6	其他各项资产	31,988,062.18	0.45
7	合计	7,096,695,716.11	100.