

富国天益价值证券投资基金

二〇一三年半年度报告

2013年06月30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

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。

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	7
§4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
§6	半年度财务报表(未经审计).....	13
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	17

6.4	报表附注.....	18
§7	投资组合报告.....	36
7.1	期末基金资产组合情况.....	36
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6	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.....	45
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8	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.....	45
7.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.10	投资组合报告附注.....	45
§8	基金份额持有人信息.....	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
§9	开放式基金份额变动.....	47
§10	重大事件揭示.....	48
10.1	基金份额持有人大会决议.....	48
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4	基金投资策略的改变.....	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8	其他重大事件.....	51
§11	备查文件目录.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国天益价值证券投资基金
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
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8号上海国金中心二期 16-17层	上海市浦东新区银城中路 188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8号上海国金中心二期 16-17层	上海市浦东新区银城中路 188号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		陈敏	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

§ 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
本期加权平均净值利润率	-2.96%
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)
期末可供分配利润	-1,619,207,024.01
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年06月30日)
基金份额累计净值增长率	408.19%

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。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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 指数由沪深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：

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

其中，t=1, 2, 3, . . . , T, T 表示时间截至日；

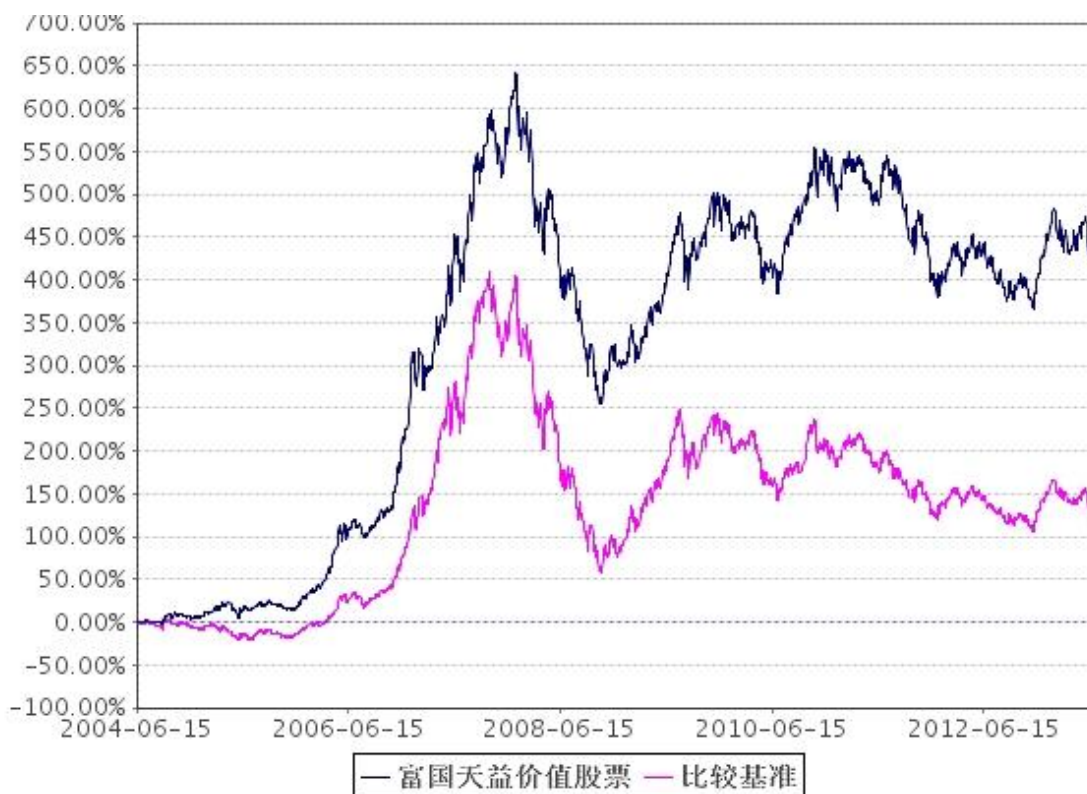
期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkT} = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, . . . ; $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + \text{benchmarkt})$ 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈戈	本基金基金经理兼任公司副总经理	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合规守信情况的说明

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、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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2013年06月30日）
活期存款	8,421,460.89
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	8,421,460.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2013年06月30日）		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		6,280,212,303.87	6,219,910,866.22	-60,301,437.65
债券	交易所市场	159,289,294.61	166,198,136.30	6,908,841.69
	银行间市场	399,906,540.00	398,284,000.00	-1,622,540.00
	合计	559,195,834.61	564,482,136.30	5,286,301.69
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		6,839,408,138.48	6,784,393,002.52	-55,015,135.96

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末（2013年06月30日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上海证券交易所市场	80,000,000.00	0.00

银行间市场	166,000,569.00	0.00
合计	246,000,569.00	0.00

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2013年06月30日）
应收活期存款利息	12,609.47
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	14,390.20
应收债券利息	7,233,311.06
应收买入返售证券利息	394,938.97
应收申购款利息	—
其他	723.60
合计	7,655,973.30

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2013年06月30日）
交易所市场应付交易费用	3,227,976.81
银行间市场应付交易费用	1,944.21
合计	3,229,921.02

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2013年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	3,191.20

预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	148,765.71
其他应付款其他	18,000.00
合计	219,545.48

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,056,919,250.94	10,056,919,250.94
本期申购	233,797,191.40	233,797,191.40
本期赎回（以“-”号填列）	-1,618,208,254.62	-1,618,208,254.62
本期末	8,672,508,187.72	8,672,508,187.72

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,805,541,052.51	258,179,587.73	-1,547,361,464.78
本期利润	263,228,072.94	-508,189,752.57	-244,961,679.63
本期基金份额交易产生的变动数	220,116,454.28	-47,000,333.88	173,116,120.40
其中：基金申购款	-38,310,600.83	11,467,615.71	-26,842,985.12
基金赎回款	258,427,055.11	-58,467,949.59	199,959,105.52
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-1,322,196,525.29	-297,010,498.72	-1,619,207,024.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
活期存款利息收入	388,547.79
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—

结算备付金利息收入	915,778.02
其他	13,146.61
合计	1,317,472.42

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
卖出股票成交总额	4,630,968,558.07
减：卖出股票成本总额	4,357,317,352.82
买卖股票差价收入	273,651,205.25

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成交总额	532,529,702.81
减：卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成本总额	523,678,313.80
减：应收利息总额	10,902,309.61
债券投资收益	-2,050,920.60

6.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无权证投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
股票投资产生的股利收益	65,088,328.29
基金投资产生的股利收益	—
合计	65,088,328.29

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
------	-----------------------------

1. 交易性金融资产	-508,189,752.57
股票投资	-510,283,875.27
债券投资	2,094,122.70
资产支持证券投资	—
基金投资	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
合计	-508,189,752.57

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
基金赎回费收入	318,121.97
基金转换费收入	153,046.33
合计	471,168.30

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
交易所市场交易费用	13,223,811.12
银行间市场交易费用	2,550.00
合计	13,226,361.12

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行划款费用	2,872.65
债券账户维护费	9,000.00
合计	210,226.93

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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	—	—

6.4.10.1.4 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

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 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：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末(2013年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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	备注
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	—

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，

其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2013年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,421,460.89	—	—	—	—	—	8,421,460.89
结算备付金	25,892,621.52	—	—	—	—	—	25,892,621.52
存出保证金	1,786,688.53	—	—	—	—	—	1,786,688.53
交易性金融资产	99,950,000.00	73,650,000.00	390,882,136.30	—	—	6,219,910,866.22	6,784,393,002.52
买入返售金融资产	246,000,569.00	—	—	—	—	—	246,000,569.00
应收证券清算款	—	—	—	—	—	19,264,629.51	19,264,629.51
应收利息	—	—	—	—	—	7,655,973.30	7,655,973.30
应收股利	—	—	—	—	—	2,591,184.76	2,591,184.76
应收申购款	—	—	—	—	—	689,586.08	689,586.08
资产总计	382,051,339.94	73,650,000.00	390,882,136.30	—	—	6,250,112,239.87	7,096,695,716.11
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	25,753,767.15	25,753,767.15
应付赎回款	—	—	—	—	—	2,710,705.01	2,710,705.01
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	9,175,228.24	9,175,228.24

应付托管费	—	—	—	—	—	1,529,204.70	1,529,204.70
应付交易费用	—	—	—	—	—	3,229,921.02	3,229,921.02
应付税费	—	—	—	—	—	776,180.80	776,180.80
其他负债	—	—	—	—	—	219,545.48	219,545.48
负债总计	—	—	—	—	—	43,394,552.40	43,394,552.40
利率敏感度缺口	382,051,339.94	73,650,000.00	390,882,136.30	—	—	6,206,717,687.47	7,053,301,163.71
上年度末（2012年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	376,136,014.14	—	—	—	—	—	376,136,014.14
结算备付金	18,812,399.38	—	—	—	—	—	18,812,399.38
存出保证金	—	—	—	—	—	1,523,789.92	1,523,789.92
交易性金融资产	149,905,000.00	57,604,165.40	395,833,678.30	134,823,233.70	77,864,000.00	7,245,232,266.51	8,061,262,343.91
买入返售金融资产	131,560,345.84	—	—	—	—	—	131,560,345.84
应收证券清算款	—	—	—	—	—	40,752,821.37	40,752,821.37
应收利息	—	—	—	—	—	11,126,221.99	11,126,221.99
应收申购款	—	—	—	—	—	1,112,707.74	1,112,707.74
资产总计	676,413,759.36	57,604,165.40	395,833,678.30	134,823,233.70	77,864,000.00	7,299,747,807.53	8,642,286,644.29

负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	111,106,233.03	111,106,233.03
应付赎回款	—	—	—	—	—	5,238,728.93	5,238,728.93
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	10,164,771.25	10,164,771.25
应付托管费	—	—	—	—	—	1,694,128.56	1,694,128.56
应付交易费用	—	—	—	—	—	2,819,688.54	2,819,688.54
应付税费	—	—	—	—	—	776,180.80	776,180.80
其他负债	—	—	—	—	—	929,127.02	929,127.02
负债总计	—	—	—	—	—	132,728,858.13	132,728,858.13
利率敏感度缺口	676,413,759.36	57,604,165.40	395,833,678.30	134,823,233.70	77,864,000.00	7,167,018,949.40	8,509,557,786.16

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动		
	2. 利率变动范围合理		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2013年06月30日）	上年度末（2012年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-182,816.51	-1,055,044.83
	2. 基准点利率减少0.1%	182,816.51	1,055,044.83

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资组合中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5%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2013年06月30日）		上年度末（2012年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产

		值比例 (%)		净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	6,219,910,866.22	88.18	7,245,232,266.51	85.14
交易性金融资产-债券投资	564,482,136.30	8.00	816,030,077.40	9.59
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	6,784,393,002.52	96.19	8,061,262,343.91	94.73

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：元）	
		本期末（2013年06月30日）	上年度末（2012年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	60,984,312.66	71,437,395.60
	2. 业绩比较基准减少 1%	-60,984,312.66	-71,437,395.60

6.4.14 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	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	4,542,945.89	0.06
C	制造业	4,228,752,712.96	59.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,488,080.00	0.08
E	建筑业	137,872,596.80	1.95
F	批发和零售业	261,407,521.04	3.71
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	411,001,655.33	5.83
J	金融业	803,786,116.85	11.40
K	房地产业	317,172,838.31	4.50
L	租赁和商务服务业	4,123,945.20	0.06
M	科学研究和技术服务业	15,414,301.50	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	30,348,152.34	0.43
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	6,219,910,866.22	88.18

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,386,344	651,430,995.28	9.24
2	002422	科伦药业	10,561,977	563,058,993.87	7.98
3	000895	双汇发展	13,806,275	530,713,211.00	7.52
4	601166	兴业银行	25,004,111	369,310,719.47	5.24
5	000581	威孚高科	8,963,548	299,292,867.72	4.24
6	002153	石基信息	13,381,347	267,894,566.94	3.80
7	000423	东阿阿胶	6,507,561	251,712,459.48	3.57
8	600031	三一重工	25,035,590	188,017,280.90	2.67
9	002028	思源电气	11,779,038	185,284,267.74	2.63
10	601989	中国重工	40,504,946	183,082,355.92	2.60
11	600585	海螺水泥	13,594,109	181,889,178.42	2.58
12	000538	云南白药	2,130,600	178,991,706.00	2.54
13	600208	新湖中宝	54,023,375	166,932,228.75	2.37
14	600016	民生银行	18,073,342	154,888,540.94	2.20
15	600309	万华化学	9,553,932	153,053,990.64	2.17
16	601169	北京银行	15,078,123	120,172,640.31	1.70
17	002375	亚厦股份	3,834,511	118,102,938.80	1.67
18	000718	苏宁环球	19,003,993	111,743,478.84	1.58
19	002271	东方雨虹	5,948,252	110,042,662.00	1.56

20	600418	江淮汽车	12,552,678	88,245,326.34	1.25
21	002024	苏宁云商	15,507,985	77,695,004.85	1.10
22	600000	浦发银行	9,373,400	77,611,752.00	1.10
23	600318	巢东股份	6,006,945	70,221,187.05	1.00
24	601933	永辉超市	4,419,744	51,578,412.48	0.73
25	000625	长安汽车	5,003,118	46,478,966.22	0.66
26	300124	汇川技术	1,328,070	46,469,169.30	0.66
27	601099	太平洋	9,088,886	45,626,207.72	0.65
28	600694	大商股份	1,516,899	43,883,888.07	0.62
29	600271	航天信息	3,062,041	40,480,182.02	0.57
30	000963	华东医药	999,940	39,847,609.00	0.56
31	002064	华峰氨纶	5,539,819	38,446,343.86	0.55
32	300258	精锻科技	3,240,715	34,027,507.50	0.48
33	600153	建发股份	5,363,747	33,737,968.63	0.48
34	300059	东方财富	2,400,430	32,525,826.50	0.46
35	600570	恒生电子	2,385,619	29,820,237.50	0.42
36	002572	索菲亚	2,003,336	27,786,270.32	0.39
37	000069	华侨城A	5,032,402	26,017,518.34	0.37
38	000338	潍柴动力	1,486,580	25,792,163.00	0.37
39	300074	华平股份	1,396,790	25,281,899.00	0.36
40	600703	三安光电	1,168,602	22,951,343.28	0.33
41	600887	伊利股份	674,297	21,092,010.16	0.30
42	600060	海信电器	2,005,256	20,834,609.84	0.30
43	601601	中国太保	1,174,113	18,703,620.09	0.27
44	600048	保利地产	1,793,070	17,769,323.70	0.25
45	000887	中鼎股份	2,818,544	17,756,827.20	0.25
46	002482	广田股份	826,313	17,352,573.00	0.25
47	600312	平高电气	1,872,574	17,265,132.28	0.24

48	300101	国腾电子	999,135	15,576,514.65	0.22
49	300215	电科院	1,009,450	15,414,301.50	0.22
50	600486	扬农化工	431,441	15,152,207.92	0.21
51	002568	百润股份	1,006,737	14,547,349.65	0.21
52	000400	许继电气	535,304	14,496,032.32	0.21
53	600267	海正药业	1,046,228	13,308,020.16	0.19
54	000651	格力电器	524,684	13,148,581.04	0.19
55	600511	国药股份	907,264	13,010,165.76	0.18
56	601318	中国平安	366,009	12,722,472.84	0.18
57	002638	勤上光电	877,183	12,113,897.23	0.17
58	002570	贝因美	431,373	12,056,875.35	0.17
59	600352	浙江龙盛	1,192,388	11,184,599.44	0.16
60	000553	沙隆达A	1,349,231	10,294,632.53	0.15
61	002440	闰土股份	476,943	9,858,411.81	0.14
62	300182	捷成股份	362,924	9,632,002.96	0.14
63	300217	东方电热	832,459	9,614,901.45	0.14
64	600406	国电南瑞	628,596	9,384,938.28	0.13
65	600498	烽火通信	565,834	9,324,944.32	0.13
66	600637	百视通	302,112	8,459,136.00	0.12
67	600066	宇通客车	411,536	7,543,454.88	0.11
68	601100	恒立油缸	757,096	7,374,115.04	0.10
69	600261	阳光照明	547,222	6,938,774.96	0.10
70	300085	银之杰	542,109	6,673,361.79	0.09
71	000712	锦龙股份	312,000	5,488,080.00	0.08
72	000671	阳光城	447,114	5,298,300.90	0.08
73	000024	招商地产	208,217	5,055,508.76	0.07
74	300287	飞利信	221,419	5,019,568.73	0.07
75	600596	新安股份	411,119	4,337,305.45	0.06

76	000826	桑德环境	134,200	4,330,634.00	0.06
77	601888	中国国旅	141,231	4,123,945.20	0.06
78	300090	盛运股份	131,915	4,073,535.20	0.06
79	300137	先河环保	217,112	4,055,652.16	0.06
80	300198	纳川股份	301,785	3,802,491.00	0.05
81	300075	数字政通	131,555	3,723,006.50	0.05
82	000926	福星股份	508,073	3,663,206.33	0.05
83	300253	卫宁软件	85,507	3,471,584.20	0.05
84	600967	北方创业	331,232	3,385,191.04	0.05
85	002005	德豪润达	362,074	3,367,288.20	0.05
86	600389	江山股份	98,440	3,350,897.60	0.05
87	002630	华西能源	152,198	3,150,498.60	0.04
88	600340	华夏幸福	95,495	3,107,407.30	0.04
89	000937	冀中能源	339,446	2,997,308.18	0.04
90	002063	远光软件	196,052	2,832,951.40	0.04
91	600518	康美药业	144,460	2,777,965.80	0.04
92	601336	新华保险	104,588	2,584,369.48	0.04
93	300168	万达信息	92,855	2,506,156.45	0.04
94	300310	宜通世纪	200,616	2,443,502.88	0.03
95	600030	中信证券	213,800	2,165,794.00	0.03
96	600686	金龙汽车	224,503	2,099,103.05	0.03
97	002612	朗姿股份	100,000	2,036,000.00	0.03
98	600649	城投控股	284,769	1,970,601.48	0.03
99	002055	得润电子	179,400	1,838,850.00	0.03
100	600388	龙净环保	79,400	1,799,998.00	0.03
101	300259	新天科技	143,959	1,751,981.03	0.02
102	600690	青岛海尔	151,148	1,649,024.68	0.02
103	600376	首开股份	294,195	1,632,782.25	0.02

104	000961	中南建设	160,800	1,572,624.00	0.02
105	600583	海油工程	238,893	1,545,637.71	0.02
106	600527	江南高纤	272,731	1,524,566.29	0.02
107	002065	东华软件	67,319	1,332,916.20	0.02
108	600750	江中药业	69,934	1,246,923.22	0.02
109	000063	中兴通讯	88,271	1,125,455.25	0.02
110	300011	鼎汉技术	108,300	1,085,166.00	0.02
111	002215	诺普信	132,380	868,412.80	0.01
112	002051	中工国际	30,300	844,461.00	0.01
113	600858	银座股份	102,156	801,924.60	0.01
114	600859	王府井	48,183	776,228.13	0.01
115	002450	康得新	25,900	724,682.00	0.01
116	002454	松芝股份	80,500	706,790.00	0.01
117	600522	中天科技	63,800	538,472.00	0.01
118	002254	泰和新材	69,725	442,056.50	0.01
119	002277	友阿股份	10,258	76,319.52	0.00
120	002550	千红制药	1,900	64,087.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000895	双汇发展	339,029,298.88	3.98
2	600031	三一重工	234,378,366.80	2.75
3	601169	北京银行	162,033,265.97	1.90
4	600016	民生银行	94,396,062.02	1.11
5	002271	东方雨虹	89,546,274.17	1.05
6	600060	海信电器	78,055,386.78	0.92

7	000581	威孚高科	72,900,343.55	0.86
8	601099	太平洋	67,457,108.69	0.79
9	600585	海螺水泥	65,603,945.38	0.77
10	002440	闰土股份	65,242,451.41	0.77
11	600352	浙江龙盛	61,078,968.91	0.72
12	002064	华峰氨纶	59,268,293.21	0.70
13	002028	思源电气	56,075,849.71	0.66
14	300074	华平股份	55,050,070.43	0.65
15	600166	福田汽车	45,578,747.54	0.54
16	600312	平高电气	45,497,588.64	0.53
17	000338	潍柴动力	45,140,928.31	0.53
18	601933	永辉超市	44,099,447.82	0.52
19	601989	中国重工	41,170,344.02	0.48
20	000400	许继电气	39,902,881.52	0.47

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超初期基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600060	海信电器	296,761,961.69	3.49
2	601318	中国平安	196,693,316.60	2.31
3	600016	民生银行	183,073,328.72	2.15
4	600036	招商银行	154,692,241.17	1.82
5	600546	山煤国际	136,580,755.73	1.61
6	600315	上海家化	136,576,862.93	1.60
7	000625	长安汽车	127,194,118.43	1.49
8	601601	中国太保	103,332,159.16	1.21
9	601699	潞安环能	91,464,075.89	1.07

10	000423	东阿阿胶	80,171,488.28	0.94
11	600585	海螺水泥	76,603,109.57	0.90
12	000001	平安银行	74,828,459.37	0.88
13	600000	浦发银行	65,767,069.58	0.77
14	000718	苏宁环球	60,100,378.50	0.71
15	002440	闰土股份	59,664,673.21	0.70
16	600352	浙江龙盛	58,839,237.10	0.69
17	601166	兴业银行	58,465,393.70	0.69
18	600805	悦达投资	57,686,301.23	0.68
19	600318	巢东股份	50,759,239.62	0.60
20	600276	恒瑞医药	48,954,259.07	0.58

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,842,279,827.80
卖出股票收入（成交）总额	4,630,968,558.07

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	398,284,000.00	5.65
	其中：政策性金融债	398,284,000.00	5.65
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—

6	中期票据	—	—
7	可转债	166,198,136.30	2.36
8	其他	—	—
9	合计	564,482,136.30	8.00

7.6 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

金额单位：人民币元

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	120228	12 国开 28	1,000,000	99,950,000.00	1.42
2	130201	13 国开 01	1,000,000	99,450,000.00	1.41
3	113003	重工转债	667,310	72,950,329.20	1.03
4	130218	13 国开 18	700,000	69,601,000.00	0.99
5	120419	12 农发 19	500,000	49,760,000.00	0.71

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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，本基金持有的贵州茅台于 2013 年 2 月 23 日公告其于 2013 年 2 月 22 日收

到贵州省物价局《行政处罚决定书》，因其控股子公司贵州茅台酒销售有限公司限定销售茅台酒最低价格，违反《中华人民共和国反垄断法》而被行政处罚。

本基金持有的科伦药业于2013年5月21日公告其于2013年5月20日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（稽查总队调查通字13139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。

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。

7.10.2 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。

报告期内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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,786,688.53
2	应收证券清算款	19,264,629.51
3	应收股利	2,591,184.76
4	应收利息	7,655,973.30
5	应收申购款	689,586.08
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	31,988,062.18

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113003	重工转债	72,950,329.20	1.03
2	113002	工行转债	43,752,000.00	0.62
3	113001	中行转债	30,033,000.00	0.43
4	110020	南山转债	12,082,116.30	0.17

5	110015	石化转债	7,380,690.80	0.10
---	--------	------	--------------	------

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	183,082,355.92	2.60	重大资产重组

7.10.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
351847	24,648.52	648,538,938.59	7.48	8,023,969,249.13	92.52

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,709,695.31	0.0658

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量为 10 万份至 50 万份。

2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年06月15日)基金份额总额	1,033,718,023.69
报告期期初基金份额总额	10,056,919,250.94
本报告期基金总申购份额	233,797,191.40
减：本报告期基金总赎回份额	1,618,208,254.62
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	8,672,508,187.72

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期本基金管理人于2013年6月7日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上公告，窦玉明先生不再担任本公司总经理，由陈敏女士代行公司总经理职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	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 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	1	2,434,942,157.05	28.74	1,079,400.00	16.97	5,123,000,000.00	40.19	—	—	2,216,766.57	29.10	—
东方证券	1	183,868,300.31	2.17	—	—	368,000,000.00	2.89	—	—	167,394.70	2.20	—
高华证券	1	133,381,198.70	1.57	—	—	1,255,000,000.00	9.85	—	—	121,429.62	1.59	—
光大证券	1	910,298,405.05	10.74	437,871.60	6.88	2,541,300,000.00	19.94	—	—	828,732.05	10.88	—
广发华福	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	260,514,846.25	3.07	4,844,971.60	76.15	652,000,000.00	5.12	—	—	237,173.42	3.11	—
恒泰证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申银万国	2	809,504,670.57	9.55	—	—	—	—	—	—	719,045.75	9.44	—
西南证券	2	1,447,848,807.18	17.09	—	—	2,116,300,000.00	16.60	—	—	1,292,406.28	16.96	—

湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
银河证券	1	250,264,791.34	2.95	—	—	690,000,000.00	5.41	—	—	227,839.29	2.99	—
中金公司	1	2,042,453,376.22	24.11	—	—	—	—	—	—	1,807,369.16	23.72	—

注：1. 我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

2. 本期内本基金租用的券商交易单元无变更。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于提请广大投资者持有效身份证件办理相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2013年01月04日
2	富国基金管理有限公司关于撤销深圳分公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2013年04月18日
3	富国基金管理有限公司关于高管人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2013年06月07日
4	富国基金管理有限公司关于新增部分基金后端收费模式及后端收费模式基金转换费率计算方式变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2013年06月15日

§ 11 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国天益价值证券投资基金的文件 2、富国天益价值证券投资基金基金合同 3、富国天益价值证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国天益价值证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。 咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司网址： http://www.fullgoal.com.cn