

富国天益价值证券投资基金 2007年半年度报告摘要

重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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...

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2007年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容...

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。

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。

一、基金简介

(一)基金简称:富国天益

交易代码:100020

运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2004年6月15日

报告期末基金份额总额:2,609,021,967.24份

(二)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...

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...

业绩比较基准:95%的中信标普300指数+5%的中国国债指数

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。

(三)基金管理人:富国基金管理有限公司

信息披露负责人:林志松

电话:95105686,4008880688(全国统一,免长途话费)

传真:021-68597999

电子邮箱:public@fulgoal.com.cn

(四)基金托管人:交通银行股份有限公司

信息披露负责人:张咏东

联系电话:021-68988917

传真:021-68408836

电子邮箱:zhangyj@bankcomm.com

(五)登载半年度报告正文的管理人互联网网址:www.fulgoal.com.cn

基金半年度报告置备地点:富国基金管理有限公司上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5.6层

交通银行上海市浦东新区银城中路188号国金大厦A座

二、主要财务指标和基金净值表现

(一)主要财务指标

Table with 2 columns: 财务指标, 2007年上半年度

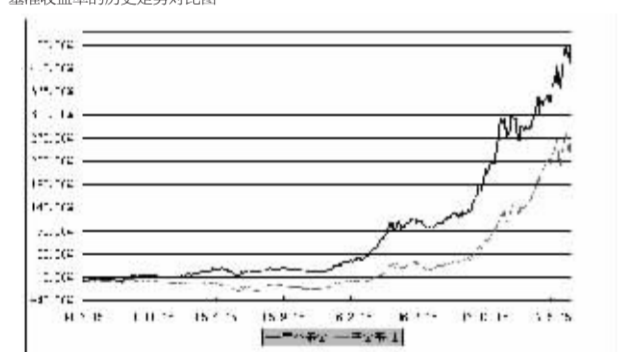
提示:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

(二)基金净值表现

1.富国天益价值证券投资基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

Table with 7 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益差③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

2.自基金合同生效以来富国天益价值证券投资基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:截止日期为2007年6月30日。

三、管理人报告

(一)基金管理人及基金经理情况

1.基金管理人

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部门登记注册成立,是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一...

2.基金经理

陈戈先生,1972年出生,硕士,自1996年开始从事证券行业工作。曾就职于君安证券研究所研究员,2000年10月加入富国基金管理有限公司...

(二)遵守守信说明

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《基金法》、《证券法》、《富国天益价值证券投资基金基金合同》以及其他有关法律法规的规定...

(三)对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明与解释

本基金在报告期内净值增长率59.69%,按照晨星分类,报告期内本基金在121个可比股票型基金中排名67,最近1年的风险评级为中。

2007年上半年,A股市场出现了持续大幅震荡行情,指数迭创新高,虽然在二季度下旬出现了大幅振荡调整,但仍然总体上保持了强势...

(四)对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

着眼下半年,我们认为目前A股市场已出现结构性泡沫,上市公司短期盈利的快速增长不能完全解释目前过高的估值...

下半年本基金仍将秉承“追求价值、注重成长”的投资理念,在自上而下的策略指导下,精选个股,做中长期投资布局。

四、托管人报告

2007年上半年,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...

2007年上半年,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。

2007年上半年,由富国基金管理有限公司编制并托管人复核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、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

五、财务会计报告(未经审计)

(一)会计报告书

1.2007年6月30日资产负债表

金额单位:人民币元

Balance Sheet table with columns: 资产, 期末数, 年初数

所附附注为本会计报表的组成部分。

2.2007年上半年度经营业绩表

金额单位:人民币元

Income Statement table with columns: 项目, 本期数, 上年同期数

所附附注为本会计报表的组成部分。

3.2007年上半年度基金收益分配表

金额单位:人民币元

Distribution Statement table with columns: 项目, 本期数, 上年同期数

所附附注为本会计报表的组成部分。

4.2007年上半年度基金净值变动表

金额单位:人民币元

NAV Change Statement table with columns: 项目, 本期数, 上年同期数

所附附注为本会计报表的组成部分。

(二)会计报表附注

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)的批准...

2.财务会计报表编制基础

本基金的会计报表系按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》...

3.主要会计政策和会计估计

(1)本年度报告会计政策所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

(2)本报告期内没有发生重大会计差错。

4.关联方关系及其交易

(1)关联方关系

Table of related parties with columns: 企业名称, 与本基金的关系

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2)通过关联方席位进行交易的

Table of transactions through related party seats with columns: 关联方名称, 股票买卖, 债券买卖, 证券回购, 权证买卖

2.报告期内累计卖出金额占期初基金资产净值比例前20名的股票明细

Table of top 20 stocks sold with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%)

注:(1)上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。

(2)股票交易佣金为成交金额的1%扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、买(卖)证管费和证券结算风险基金等)...

(3)关联方位于的银行间同业市场的债券(含回购)交易

A.本基金于2007年上半年度未通过银行间同业市场与关联方进行债券(含回购)交易。

B.本基金2006年上半年度未通过银行间同业市场与关联方进行债券(含回购)交易。

(4)基金管理人报酬—基金管理费

A.基金管理费按前一日基金资产净值的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

B.基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

基金托管人报酬—基金托管费

A.基金托管费按前一日基金资产净值的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

B.基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

(七)投资组合报告附注

1.报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

2.报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

3.截至2007年6月30日,本基金的其他资产项目包括:

Table of other assets with columns: 序号, 其他资产项目, 金额(元)

(八)债券投资组合

(一)基金投资组合情况

截至2007年6月30日,富国天益价值证券投资基金资产净值为6,369,696,660.01元,基金份额净值为2.4414元,基金份额累计净值为3.3979元...

(二)按行业分类的股票投资组合

Table of stock portfolio by industry with columns: 序号, 分类, 市值(元), 市值占基金资产净值比例(%)

(三)报告期内前十名股票投资明细

Table of top 10 stocks with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(股), 市值(元), 市值占基金资产净值比例(%)

注:机构投资者了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

(四)报告期内股票投资组合的重大变动

1.报告期内累计买入价值占期初基金资产净值前20名的股票明细

Table of top 20 stocks bought with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计买入金额(元), 占期初基金资产净值比例(%)

注:上述佣金不包括上海及深圳交易所收取的证券结算风险基金

9.本公司从2007年1月23日起调整本基金直销网站首次申购金额和追加申购金额限制...

10.本公司从2007年1月25日起调整本基金前端申购费率,并于同日在中国证券报、上海证券报、证券时报和本公司网站上发布了相关公告。

11.本公司从2007年2月5日起在新的办公地址办公,本公司已分别于2007年2月1日、2月5日就上述事宜在中国证券报、上海证券报、证券时报和本公司网站上发布了相关公告。

12.本公司从2007年3月7日起将申购以后后端收费模式申购的本基金向富国天益价值市场基金转换的业务,并于同日在中国证券报、上海证券报、证券时报和本公司网站上发布了相关公告。

13.根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等法律法规的有关规定及中国证监会基金部通知[2007]10号《关于统一规范证券投资基金(申)购费用及认(申)购费用计算方法有关问题的通知》的要求...