

富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金  
(原汉鼎证券投资基金转型)  
2009 年第 2 季度报告

2009 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： 中国工商银行股份有限公司

报告送出日期： 2009 年 07 月 21 日

## § 1 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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 4 月 1 日起至 2009 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金

基金简称	富国天鼎中证指数增强
交易代码	前端交易代码：100032 后端交易代码：100033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月20日
报告期末基金份额总额（单位：份）	334,335,864.58
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，其在遵循“程序化指数投资、有限度个股调整、精细化风险管理”原则的基础上，实现对中证红利指数的有效跟踪并力争实现超越，分享中国经济长期增长所带来的收益。
投资策略	本基金将采用“指数化投资为主、主动性投资为辅”的投资策略，在完全复制目标指数的基础上有限度地调整个股，从而最大限度降低由于交易成本造成的股票投资组合相对于目标指数的偏离，并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	$90\% \times \text{中证红利指数收益率} + 10\% \times \text{一年期银行储蓄存款利率（税后）}$
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。
基金管理人	富国基金管理有限公司

基金托管人	中国工商银行股份有限公司
-------	--------------

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	(2009年4月1日到2009年6月30日)
1. 本期已实现收益	62,551,597.50
2. 本期利润	84,784,901.54
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2060
4. 期末基金资产净值	469,242,164.18
5. 期末基金份额净值	1.404

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 富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	18.58%	1.53%	17.94%	1.53%	0.64%	0.00%

注：过去三个月指2009年4月1日—2009年6月30日

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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2009年6月30日。本基金于2008年11月20日成立，建仓期6个月，即从2008年11月20日至2009年5月19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		
宋小龙	本基金基金经理兼任富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金经理。	2006-12-19	—	11年	硕士，曾任北京北大青鸟有限责任公司系统开发部项目经理；1999年至今任富国基金管理有限公司信息技术部项目经理、研究部行业研究员、高级研究员，现任富国天瑞基金经理、富国天鼎基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
常松	本基金基金经理。	2008-11-20	—	9年	博士，2001年至今任富国基金管理有限公司数量研究员、高级数量研究员、研究策划部数量组组长、

					金融数量工程部经理，现任富国天鼎基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
--	--	--	--	--	-------------------------------------

## 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天鼎中证红利指数增强型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》、《富国天鼎中证红利指数增强型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，以在充分重视本金长期安全的前提下，力争为基金持有人创造较高的当期收益为目标，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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，严格执行交易系统中的公平交易程序，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

### 4.3.3 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。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

在 09 年 1 季度，我们从宏观层面和微观层面都观测到 2009 年中国经济复苏，并判断复苏的速度将超出大部分人预期，A 股市场的表现也将超出此前大部分人的预期，事实上 09 年 2 季度各方面表现确实如此。

从目前来看，经济复苏的趋势已经非常明确，投资、出口和消费各项宏观指标从环比来看恢复的速度都很快，并且在可以预见的未来 1 个季度内具有持续性。不好的消息在于，经过半年多单边上涨，市场的估值已经不便宜，市场的情绪从极度悲观已经转变为乐观。虽然有所担心，但是从历史上来看，在宏观基本面向好，

资金活期化倾向较强的情况，市场的表现总是不存在大的向下的系统性风险。所以展望未来，我们相信投资者仍然能够在未来一段时间内享受中国经济复苏所带来的愉悦。

对于我们所跟踪的中证红利指数，由于只有很少与金融、房地产行业相关的股票，所以最近的表现不如全市场基准指数沪深 300。但是我们相信，在中国经济走向复苏的过程中，以中证红利指数样本股为代表的中上游周期性行业的盈利能力将越来越明显，包括钢铁、有色、化工和电力等行业。

由于预期中证红利指数在中国经济复苏的过程中表现会比较好，此时采取增强的策略并非明智的选择。因此在本报告期内，在跟踪的策略上，本基金仍然采取了完全复制的策略。

在本报告期内，本基金受到了较多次的大额申购赎回的影响，为应对申购赎回，不仅付出了较多的交易成本，同时由于被动的股票仓位变化，对跟踪效果产生了一定影响。我们将努力工作，争取运用更多组合管理的方法来减少这种影响，从而提高基金的业绩，希望本基金持有人能够成为中国经济复苏过程中最为快乐的投资者。

## § 5 富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	433,978,384.62	89.74
	其中：股票	433,978,384.62	89.74
2	固定收益投资	10,081,000.00	2.08
	其中：债券	10,081,000.00	2.08
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	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	37,489,968.40	7.75
6	其他资产	2,021,426.28	0.42
7	合计	483,570,779.30	100.00

### 5.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	—	—
C	制造业	—	—
C0	食品、饮料	—	—
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	—	—
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	—	—
C7	机械、设备、仪表	—	—
C8	医药、生物制品	—	—
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	—	—
H	批发和零售贸易	—	—
I	金融、保险业	—	—
J	房地产业	—	—
K	社会服务业	—	—
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	—	—

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 5.3 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	4,894,404.94	1.04
B	采掘业	52,930,849.54	11.28
C	制造业	239,147,112.70	50.96
C0	食品、饮料	8,665,184.99	1.85
C1	纺织、服装、皮毛	12,407,688.77	2.64
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	1,982,646.96	0.42
C4	石油、化学、塑胶、塑料	36,026,839.24	7.68
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	136,175,046.78	29.02
C7	机械、设备、仪表	35,886,905.56	7.65
C8	医药、生物制品	8,002,800.40	1.71
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	37,269,537.80	7.94

E	建筑业	3,352,171.20	0.71
F	交通运输、仓储业	57,284,427.14	12.21
G	信息技术业	7,420,602.88	1.58
H	批发和零售贸易	17,098,553.00	3.64
I	金融、保险业	—	—
J	房地产业	7,315,799.10	1.56
K	社会服务业	7,264,926.32	1.55
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	433,978,384.62	92.48

#### 5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601006	大秦铁路	2,184,636	23,135,295.24	4.93
2	600019	宝钢股份	2,948,125	20,754,800.00	4.42
3	000983	西山煤电	678,990	20,301,801.00	4.33
4	600005	武钢股份	1,760,447	13,872,322.36	2.96
5	000898	鞍钢股份	1,035,751	13,661,555.69	2.91
6	000792	盐湖钾肥	225,004	12,406,720.56	2.64
7	000825	太钢不锈	1,598,373	12,275,504.64	2.62
8	600011	华能国际	1,515,569	12,063,929.24	2.57
9	600104	上海汽车	735,518	10,995,994.10	2.34
10	000060	中金岭南	401,799	8,634,660.51	1.84

#### 5.4.1 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 5.4.2 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601006	大秦铁路	2,184,636	23,135,295.24	4.93
2	600019	宝钢股份	2,948,125	20,754,800.00	4.42
3	000983	西山煤电	678,990	20,301,801.00	4.33
4	600005	武钢股份	1,760,447	13,872,322.36	2.96
5	000898	鞍钢股份	1,035,751	13,661,555.69	2.91

## 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	10,081,000.00	2.15
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	—	—
7	其他	—	—
8	合计	10,081,000.00	2.15

## 5.6 报告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

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	098052	09 轻纺城	100,000	10,081,000.00	2.15

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

## 5.8 报告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。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1 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。

本报告期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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.9.2 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。

本报告期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。

### 5.9.3 报告期末其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	943,610.27
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	62,599.32

4	应收利息	100,245.88
5	应收申购款	885,293.35
6	其他应收款	—
7	待摊费用	29,677.46
8	其他	—
9	合计	2,021,426.28

#### 5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000792	盐湖钾肥	12,406,720.56	2.64	筹划重大事项

#### 5.9.6 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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	398,563,360.83
报告期期间基金总申购份额	243,654,895.74
报告期期间基金总赎回份额	307,882,391.99
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	334,335,864.58

### § 7 备查文件目录

#### 7.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立汉鼎证券投资基金的文件
- 2、汉鼎证券投资基金基金合同
- 3、汉鼎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、汉鼎证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、中国证监会《关于核准汉鼎证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金

运作方式决议的批复》

7、富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金基金合同

8、富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金托管协议

9、富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金财务报表及报表附注

10、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

## **7.2 存放地点**

上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5 层

## **7.3 查阅方式**

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>

富国基金管理有限公司

2009 年 07 月 21 日