

富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金

二 00 九年半年度报告

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

送出日期： 2009 年 08 月 27 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 8 月 25 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 2009 年 1 月 1 日起至 2009 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..... | 5 |
| 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..... | 6 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 | 基金净值表现..... | 7 |
| §4 | 管理人报告..... | 8 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 9 |
| 4.3 | 管理人对公平交易的专项说明..... | 9 |
| 4.4 | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明..... | 10 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 10 |
| 4.6 | 管理人对基金估值程序等事项的说明..... | 11 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 11 |
| §5 | 托管人报告..... | 11 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| §6 | 半年度财务会计报告(未经审计)..... | 12 |
| 6.1 | 资产负债表..... | 12 |
| 6.2 | 利润表..... | 13 |
| 6.3 | 所有者权益(基金净值)变动表..... | 14 |
| 6.4 | 报表附注..... | 15 |
| §7 | 投资组合报告..... | 29 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况..... | 29 |
| 7.2 | 期末积极投资按行业分类的股票投资组合..... | 30 |
| 7.3 | 期末指数投资按行业分类的股票投资组合..... | 30 |
| 7.4 | 报告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..... | 31 |
| 7.5 | 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 34 |
| 7.6 | 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 35 |
| 7.7 | 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..... | 36 |
| 7.8 | 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..... | 36 |
| 7.9 | 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..... | 36 |
| 7.10 | 投资组合报告附注..... | 36 |
| §8 | 基金份额持有人信息..... | 37 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 37 |

| | | |
|------|-----------------------------------|----|
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 | 37 |
| §9 | 开放式基金份额变动..... | 38 |
| §10 | 重大事件揭示..... | 38 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议..... | 38 |
| 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 | 38 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 38 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变..... | 38 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 38 |
| 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 | 38 |
| 10.7 | 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 39 |
| 10.8 | 其他重大事件..... | 40 |
| §11 | 备查文件目录..... | 40 |
| 11.1 | 备查文件目录..... | 40 |
| 11.2 | 存放地点..... | 40 |
| 11.3 | 查阅方式..... | 41 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------------------|
| 基金名称 | 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 | 334,335,864.58份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 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%×中证红利指数收益率+10%×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。 |

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 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李长伟 | 蒋松云 |
| | 联系电话 | 021-68597788 | 010—66105799 |
| | 电子邮箱 | public@fullgoal.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | 95105686、4008880688 | 95588 | |
| 传真 | 021-68597799 | 010—66105798 | |
| 注册地址 | 上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层 | 北京市西城区复兴门内大街55号 | |
| 办公地址 | 上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层 | 北京市西城区复兴门内大街55号 | |
| 邮政编码 | 200120 | 100140 | |
| 法定代表人 | 陈敏 | 姜建清 | |

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 上海市浦东新区花园石桥路 33 号 花旗集团大厦 5、6 层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 注册登记机构 |
|------|-------------------------------|
| 名称 | 富国基金管理有限公司 |
| 办公地址 | 上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 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(2009年1月1日-2009年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 123,253,763.82 |
| 本期利润 | 202,087,710.85 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3830 |
| 本期加权平均净值利润率 | 33.09% |
| 本期基金份额净值增长率 | 40.26% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2009年6月30日 |
| 期末可供分配利润 | 116,482,264.89 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3484 |
| 期末基金资产净值 | 469,242,164.18 |
| 期末基金份额净值 | 1.404 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2009年6月30日 |
| 基金份额累计净值增长率 | 44.45% |

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 | 8.33% | 1.14% | 7.82% | 1.15% | 0.51% | -0.01% |
| 过去三个月 | 18.58% | 1.53% | 17.94% | 1.53% | 0.64% | 0.00% |
| 过去六个月 | 40.26% | 1.86% | 60.74% | 1.95% | -20.48% | -0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 44.45% | 1.67% | 48.17% | 1.95% | -3.72% | -0.28% |

注：本基金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 = 90% × 中证红利指数收益率 + 10% × 一年期银行储蓄存款利率（税后）。中证红利指数由中证指数有限公司编制和计算，其挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的 100 只股票作为样本，以反映 A 股市场高红利股票的整体状况和走势。

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（benchmark_t）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 90\% * [\text{中证红利指数}_t / (\text{中证红利指数}_{t-1}) - 1] + 10\% * \text{一年期银行定期存款利率} / 360 ;$$

其中，t=1, 2, 3, ···, T, T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmark_T）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ···； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + \text{benchmark}_t)$ 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 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 2009 年 6 月 30 日，本基金管理人管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金三只封闭式证券投资基金和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、富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金及富国优化增强债券型证券投资基金十一只开放式证券投资基金。

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 | | |
| 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。 |

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 管理人对公平交易的专项说明

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，严格执行交易系统内的公平交易程序，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本基金在报告期内净值增长率 40.26%。

2009 年上半年，以 2009 年 1 月 23 日为分界线分为两个阶段：

第一个阶段是 1 月 23 日前，本基金尚没有打开申购赎回。在这此期间内，市场从前期 2100 点下跌到 1800 点左右，又上升到 2000 点左右。市场具备了战略性的投资机会。但从当时来看，我们认为短期内并没有明朗的战术性机会。因此，本基金选择了控制下行风险的策略，由此错过了在 1800 点左右的最佳建仓时机，造成从年初来跑输基准的结果，给持有人造成了 10%左右的机会成本损失，这是本基金上半年运作最大的失误之处。

第二个阶段是 1 月 23 日后，本基金打开申购赎回。观察到宏观层面，作为经济先行指标的货币供应量数据超出所有人预期，观察到微观层面，工程机械，基础建设以及汽车等企业销售量和订单超预期。在此基础上，我们认为 2009 年中国经济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，由此，本基金选择了快速建仓的策略，使本基金表现紧跟基准表现。

基于对整个市场上半年良好表现预期基础上，在跟踪策略上本基金采取了完全复制的策略。

我们认为在中国经济走向复苏的过程中，中证红利指数的表现将超越 A 股市场上绝大部分市场基准指数。因为在经济快速恶化过程中，以中证红利指数样本股为代表的周期性行业的盈利能力受到最大的打击、包括钢铁、有色、化工和电力等行业。那么我们相信，在经济复苏的过程中，中证红利指数样本股盈利恢复速度将同样迅速。同时，由于前期市场对于这些周期性行业过于悲观的预期，一旦经济复苏产生乐观预期，那么这些行业的市场表现还会受益于估值修复的过程，前期越是悲观的周期性行业得到修复的幅度也将越大。

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。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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，所以前期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。由此，我们预期所跟踪的中证红利指数在未来将会在经济复苏的过程中有良好的表现。

4.6 管理人对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

本基金本报告期末进行利润分配。

本基金严格按照相关法律法规及基金合同约定进行利润分配。

§ 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

2009年上半年，本基金托管人在对富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2009年上半年，富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金的托管人——富国基金管理有限公司在富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金 2009 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2009年8月25日

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金

报告截止日：2009年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 (2009年06月30日) | 上年度末 (2008年12月31日) |
|-----------------|------------|------------------------------|-------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 36,315,324.30 | 358,405,307.33 |
| 结算备付金 | | 1,174,644.10 | 453,633.40 |
| 存出保证金 | | 943,610.27 | 348,780.49 |
| 交易性金融资产 | | 444,059,384.62 | 245,808,453.20 |
| 其中：股票投资 | | 433,978,384.62 | 48,321,200.00 |
| 债券投资 | | 10,081,000.00 | 197,487,253.20 |
| 资产支持证券投资 | | — | — |
| 衍生金融资产 | | — | — |
| 买入返售金融资产 | | — | — |
| 应收证券清算款 | | — | 300,093,000.00 |
| 应收利息 | | 100,245.88 | 1,939,682.21 |
| 应收股利 | | 62,599.32 | — |
| 应收申购款 | | 885,293.35 | — |
| 其他资产 | | 29,677.46 | 1,021,322.78 |
| 资产总计 | | 483,570,779.30 | 908,070,179.41 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 (2009年06月30日) | 上年度末 (2008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 | | 11,722,353.21 | — |
| 应付赎回款 | | 973,644.76 | — |
| 应付管理人报酬 | | 540,585.01 | 623,660.07 |
| 应付托管费 | | 90,097.47 | 103,943.35 |
| 应付销售服务费 | | — | — |
| 应付交易费用 | | 404,949.47 | 268,655.03 |
| 应交税费 | | 42,474.93 | 42,474.93 |
| 应付利息 | | — | — |
| 应付利润 | | — | — |
| 其他负债 | | 554,510.27 | 362,148.35 |

| | | | |
|---------------|--|----------------|----------------|
| 负债合计 | | 14,328,615.12 | 1,400,881.73 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 297,025,952.44 | 804,544,654.78 |
| 未分配利润 | | 172,216,211.74 | 102,124,642.90 |
| 所有者权益合计 | | 469,242,164.18 | 906,669,297.68 |
| 负债和所有者权益总计 | | 483,570,779.30 | 908,070,179.41 |

注：报告截止日 2009 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.404 元，基金份额总额 334,335,864.58 份。所附附注为本会计报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金

本报告期：2009 年 01 月 01 日至 2009 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注 号 | 本期 (2009 年 01 月 01 日至 2009 年 06 月 30 日) | 上年度可比期间 (2008 年 01 月 01 日至 2008 年 06 月 30 日) |
|----------------------------|---------|---|--|
| 一、收入 | | 209,218,420.59 | — |
| 1. 利息收入 | | 1,278,049.60 | — |
| 其中：存款利息收入 | | 431,793.05 | — |
| 债券利息收入 | | 631,756.55 | — |
| 资产支持证券利息收入 | | — | — |
| 买入返售金融资产收入 | | 214,500.00 | — |
| 其他利息收入 | | — | — |
| 2. 投资收益（损失以“-”号填列） | | 127,746,658.46 | — |
| 其中：股票投资收益 | | 118,105,723.51 | — |
| 债券投资收益 | | 4,972,182.37 | — |
| 资产支持证券投资收益 | | — | — |
| 衍生工具投资收益 | | — | — |
| 股利收益 | | 4,668,752.58 | — |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | 78,833,947.03 | — |
| 4. 其他收入（损失以“-”号填列） | | 1,359,765.50 | — |
| 二、费用（以“-”号填列） | | -7,130,709.74 | — |
| 1. 管理人报酬 | | -3,715,602.37 | — |
| 2. 托管费 | | -619,267.03 | — |
| 3. 销售服务费 | | — | — |
| 4. 交易费用 | | -2,477,403.51 | — |
| 5. 利息支出 | | — | — |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | — | — |
| 6. 其他费用 | | -318,436.83 | — |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 202,087,710.85 | — |

注：本基金合同生效日为 2008 年 11 月 20 日，无上年同期比较数据。

所附附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金

本报告期：2009年01月01日至2009年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 (2009年01月01日至2009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） | 804,544,654.78 | 102,124,642.90 | 906,669,297.68 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | — | 202,087,710.85 | 202,087,710.85 |
| 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) | -507,518,702.34 | -131,996,142.01 | -639,514,844.35 |
| 其中：1. 基金申购款 | 323,998,214.72 | 128,619,717.40 | 452,617,932.12 |
| 2. 基金赎回款(以“-”号填列) | -831,516,917.06 | -260,615,859.41 | -1,092,132,776.47 |
| 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） | 297,025,952.44 | 172,216,211.74 | 469,242,164.18 |
| 项目 | 上年度可比期间 (2008年01月01日至2008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） | — | — | — |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | — | — | — |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变 动数(净值减少以“-”号填列) | — | — | — |
| 其中：1. 基金申购款 | — | — | — |
| 2. 基金赎回款(以“-”号填列) | — | — | — |
| 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） | — | — | — |

注：本基金合同生效日为2008年11月20日，无上年同期比较数据。
所附附注为本会计报表的组成部分。

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）由汉鼎证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会 2008 年 11 月 11 日证监许可[2008]1261 号文《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》，汉鼎证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市交易，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金”。自 2008 年 11 月 20 日起，《富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《汉鼎证券投资基金基金合同》失效。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为富国基金管理有限公司，注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据上述证监许可[2008]1261 号文的核准，基金管理人于 2008 年 11 月 27 日至 2008 年 12 月 24 日向社会开放集中申购，集中申购期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2008）验字第 60467606_B02 号验资报告。集中申购扣除申购费后的净申购金额为人民币 341,738,891.01 元，在集中申购期间产生的利息为人民币 21,457.10 元，以上实收基金合计为人民币 341,760,348.11 元，折合 341,760,348.11 份基金份额。另外，集中申购验资结束日同时为原汉鼎证券投资基金的拆分日。拆分日，基金管理人原汉鼎证券投资基金通过基金份额拆分，使得验资结束当日基金份额净值为 1.000 元，再根据当日基金份额净值（1.000 元）计算投资者集中申购应获得的基金份额，并由注册登记机构根据基金管理人进行投资者集中申购份额的登记确认。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证红利指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

基金业绩比较基准为： $90\% \times \text{中证红利指数收益率} + 10\% \times \text{一年期银行储蓄存款利率}$ （税后）。

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、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》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

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 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 年上半年的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

本报告期内本基金所采用的会计政策、会计估计与上年度报表相一致。

6.4.4.1 会计政策变更的说明

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.5 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、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2009年06月30日） |
|------|------------------|
| 活期存款 | 36,315,324.30 |
| 定期存款 | — |
| 其他存款 | — |
| 合计 | 36,315,324.30 |

注：本基金本期末未投资于定期存款。

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末（2009年06月30日） | | |
|--------|-------|------------------|----------------|---------------|
| | | 成本 | 公允价值 | 估值增值 |
| 股票 | | 340,661,690.68 | 433,978,384.62 | 93,316,693.94 |
| 债券 | 交易所市场 | — | — | — |
| | 银行间市场 | 10,000,000.00 | 10,081,000.00 | 81,000.00 |
| | 合计 | 10,000,000.00 | 10,081,000.00 | 81,000.00 |
| 资产支持证券 | | — | — | — |
| 其他 | | — | — | — |
| 合计 | | 350,661,690.68 | 444,059,384.62 | 93,397,693.94 |

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 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交易中取得的债券

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2009年06月30日） |
|------------|------------------|
| 应收活期存款利息 | 10,880.37 |
| 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 | 369.99 |
| 应收债券利息 | 88,964.38 |
| 应收买入返售证券利息 | — |
| 应收申购款利息 | — |

| | |
|----|------------|
| 其他 | 31.14 |
| 合计 | 100,245.88 |

6.4.6.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2009年06月30日） |
|-------|------------------|
| 其他应收款 | — |
| 待摊费用 | 29,677.46 |
| 合计 | 29,677.46 |

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2009年06月30日） |
|-------------|------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 404,949.47 |
| 银行间市场应付交易费用 | — |
| 合计 | 404,949.47 |

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2009年06月30日） |
|-------------|------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 250,000.00 |
| 应付赎回费 | 3,924.63 |
| 预提审计费 | 39,671.58 |
| 预提信息披露费 | 148,765.71 |
| 指数使用费 | 50,000.00 |
| 其他 | 62,148.35 |
| 合计 | 554,510.27 |

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） | |
|------|-----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 905,559,026.38 | 804,544,654.78 |
| 本期申购 | 364,710,993.73 | 323,998,214.72 |
| 本期赎回 | -935,934,155.53 | -831,516,917.06 |
| 本期末 | 334,335,864.58 | 297,025,952.44 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额

6.4.6.10 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 | 79,204,658.62 | 22,919,984.28 | 102,124,642.90 |
| 本期利润 | 123,253,763.82 | 78,833,947.03 | 202,087,710.85 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -85,976,157.55 | -46,019,984.46 | -131,996,142.01 |

| | | | |
|----------|-----------------|----------------|-----------------|
| 其中：基金申购款 | 75,449,145.14 | 53,170,572.26 | 128,619,717.40 |
| 基金赎回款 | -161,425,302.69 | -99,190,556.72 | -260,615,859.41 |
| 本期已分配利润 | — | — | — |
| 本期末 | 116,482,264.89 | 55,733,946.85 | 172,216,211.74 |

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|-----------|-----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 405,932.50 |
| 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 | 23,216.28 |
| 其他 | 2,644.27 |
| 合计 | 431,793.05 |

6.4.6.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|----------|-----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 742,364,973.74 |
| 卖出股票成本总额 | -624,259,250.23 |
| 股票投资收益 | 118,105,723.51 |

6.4.6.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|-----------------------|-----------------------------|
| 卖出债券（含债转股及债券到期兑付）成交金额 | 198,456,583.87 |
| 卖出债券（含债转股及债券到期兑付）成本总额 | -191,064,125.83 |
| 应收利息总额 | -2,420,275.67 |
| 债券投资收益 | 4,972,182.37 |

6.4.6.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本期末无权证投资收益。

6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|-------------|-----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 4,668,752.58 |
| 合计 | 4,668,752.58 |

6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|------|-----------------------------|
|------|-----------------------------|

| | |
|------------|---------------|
| 1. 交易性金融资产 | 78,833,947.03 |
| 股票投资 | 85,176,074.40 |
| 债券投资 | -6,342,127.37 |
| 资产支持证券投资 | — |
| 2. 衍生工具 | — |
| 权证投资 | — |
| 3. 其他 | — |
| 合计 | 78,833,947.03 |

6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|---------|-----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,347,600.69 |
| 转换费收入 | 12,164.81 |
| 合计 | 1,359,765.50 |

6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|-----------|-----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 2,477,403.51 |
| 银行间市场交易费用 | — |
| 合计 | 2,477,403.51 |

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|---------|-----------------------------|
| 审计费用 | 39,671.58 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 银行汇划费用 | 577.00 |
| 债券帐户维护费 | 9,000.00 |
| 指数使用费 | 120,322.54 |
| 其他费用 | 100.00 |
| 合计 | 318,436.83 |

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 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、基金发起人、注册登记人、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（“申银万国证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 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

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） | | 上年度可比期间（2008年01月01日至2008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 | 986,602,163.33 | 59.18 | — | — |
| 申银万国 | 646,403,955.70 | 38.77 | — | — |

注：本基金合同生效日为2008年11月20日，无上年同期比较数据。

6.4.9.1.2 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方进行权证交易。本基金合同生效日为2008年11月20日，无上年同期比较数据。

6.4.9.1.3 债券交易

注：本基金本报告期末通过关联方进行债券交易。本基金合同生效日为2008年11月20日，无上年同期比较数据。

6.4.9.1.4 回购交易

注：本基金本报告期末通过关联方进行回购交易。本基金合同生效日为2008年11月20日，无上年同期比较数据。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2009年01月01日至2009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 | 838,611.76 | 60.27 | 247,831.48 | 61.20 |
| 申银万国 | 525,208.80 | 37.74 | 156,630.68 | 38.68 |

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。本基金合同生效日为2008年11月20日，无上年同期比较数据。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期(2009年01月01日至2009年06月30日) | 上年度可比期间(2008年01月01日至2008年06月30日) |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期应支付的管理费 | 3,715,602.37 | — |
| 其中：当期已支付 | 3,175,017.36 | — |
| 期末未支付 | 540,585.01 | — |

注：本基金合同生效日为2008年11月20日，无上年同期比较数据。本基金的管理费按该基金资产净值的1.20%年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上期应付管理费。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期(2009年01月01日至2009年06月30日) | 上年度可比期间(2008年01月01日至2008年06月30日) |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期应支付的托管费 | 619,267.03 | — |
| 其中：当期已支付 | 529,169.56 | — |
| 期末未支付 | 90,097.47 | — |

注：本基金合同生效日为2008年11月20日，无上年同期比较数据。本基金的托管费按基金资产净值的0.20%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上期应付托管费。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金合同于2008年11月20日生效，无上年同期比较数据。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期(2009年01月01日至2009年06月30日) | 上年度可比期间(2008年01月01日至2008年06月30日) |
|-------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 期初持有的基金份额 | 27,253,571.72 | — |
| 期间认购总份额 | — | — |
| 期间申购/买入总份额 | — | — |
| 期间赎回/卖出总份额 | -27,253,571.72 | — |
| 期间拆分增加份额 | — | — |
| 期末持有的基金份额 | — | — |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | — | — |

注：本基金合同生效日为2008年11月20日，无上年同期比较数据。

6.4.9.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末(2009年06月30日) | | 上年度末(2008年12月31日) | |
|--------------|------------------|---------------------|-------------------|---------------------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例(%) | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例(%) |
| 申银万国证券股份有限公司 | 2,813,886.78 | 0.84 | 22,812,886.78 | 2.52 |

6.4.9.5 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(2009年01月01日至2009年06月30日) | | 上年度可比期间(2008年01月01日至2008年06月30日) | |
|--------------|-----------------------------|------------|----------------------------------|----------|
| | 期末存款余额 | 当期存款利息收入 | 期末存款余额 | 当期存款利息收入 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 36,315,324.30 | 405,932.50 | — | — |

注：本基金合同生效日为2008年11月20日，无上年同期比较数据。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金合同生效日为2008年11月20日，无上年同期比较数据。

6.4.10 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.11 期末（2009年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金未因认购新发/增发证券而于本报告期末（2009年6月30日）持有的流通受限证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

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 |
|--------|------|-----------|--------|------------|----------------|------------|--------------|---------------|---------------|
| 000792 | 盐湖钾肥 | 2009-6-26 | 筹划重大事项 | 55.14 | 2009-07-2 7 | 60.65 | 225,004 | 10,859,042.96 | 12,406,720.56 |

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末（2009年6月30日）止，本基金无银行间市场债券正回购余额；无因银行间市场债券正回购而作为抵押的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末（2009年6月30日）止，本基金无交易所市场债券正回购余额；无因交易所市场债券正回购而作为抵押的债券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 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，本基金所持所有证券均能及时变现。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。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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、权证存出保证金及债券投资等。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

注：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（2009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 | 36,315,324.30 | - | - | - | - | - | 36,315,324.30 |
| 结算备付金 | 1,174,644.10 | - | - | - | - | - | 1,174,644.10 |
| 存出保证金 | 98,780.49 | - | - | - | - | 844,829.78 | 943,610.27 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 10,081,000.00 | - | 433,978,384.62 | 444,059,384.62 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 100,245.88 | 100,245.88 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 62,599.32 | 62,599.32 |
| 应收申购款 | 885,293.35 | - | - | - | - | - | 885,293.35 |
| 待摊费用 | - | - | - | - | - | 29,677.46 | 29,677.46 |
| 资产总计 | 38,474,042.24 | - | - | 10,081,000.00 | - | 435,015,737.06 | 483,570,779.30 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 11,722,353.21 | 11,722,353.21 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 973,644.76 | 973,644.76 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 540,585.01 | 540,585.01 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 90,097.47 | 90,097.47 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 404,949.47 | 404,949.47 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | 42,474.93 | 42,474.93 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 554,510.27 | 554,510.27 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 14,328,615.12 | 14,328,615.12 |
| 利率敏感度缺口 | 38,474,042.24 | - | - | 10,081,000.00 | - | 420,687,121.94 | 469,242,164.18 |
| 上年度末（2008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 | 358,405,307.33 | - | - | - | - | - | 358,405,307.33 |
| 结算备付金 | 453,633.40 | - | - | - | - | - | 453,633.40 |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|---|---------------|---------------|--------------|----------------|----------------|
| 存出保证金 | 98,780.49 | - | - | - | - | 250,000.00 | 348,780.49 |
| 交易性金融资产 | - | - | 97,047,385.10 | 93,311,845.00 | 7,128,023.10 | 48,321,200.00 | 245,808,453.20 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 300,093,000.00 | 300,093,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,939,682.21 | 1,939,682.21 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 1,021,322.78 | 1,021,322.78 |
| 资产总计 | 358,957,721.22 | - | 97,047,385.10 | 93,311,845.00 | 7,128,023.10 | 351,625,204.99 | 908,070,179.41 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 623,660.07 | 623,660.07 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 103,943.35 | 103,943.35 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 268,655.03 | 268,655.03 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | 42,474.93 | 42,474.93 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 362,148.35 | 362,148.35 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 1,400,881.73 | 1,400,881.73 |
| 利率敏感度缺口 | 358,957,721.22 | - | 97,047,385.10 | 93,311,845.00 | 7,128,023.10 | 350,224,323.26 | 906,669,297.68 |

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：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：千元） | |
| | | 本期末（2009年06月30日） | 上年度末（2008年12月31日） |
| | 1. 基准点利率增加0.1% | -25.41 | -411.64 |
| | 2. 基准点利率减少0.1% | 25.41 | 411.64 |

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2009年06月30日） | | 上年度末（2008年12月31日） | |
|--------------|------------------|--------------|-------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | 433,978,384.62 | 92.48 | 48,321,200.00 | 5.33 |
| 交易性金融资产—债券投资 | 10,081,000.00 | 2.15 | 197,487,253.20 | 21.78 |
| 衍生金融资产—权证投资 | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — |
| 合计 | 444,059,384.62 | 94.63 | 245,808,453.20 | 27.11 |

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：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，除市场基准发生变动，其他影响基金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：千元） | |
| | | 本期末（2009年06月30日） | 上年度末（2008年12月31日） |
| | 1. 业绩比较基准减少1% | -4,239.39 | -1,325.63 |
| | 2. 业绩比较基准增加1% | 4,239.39 | 1,325.63 |

6.4.13 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 | 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 |

7.2 期末积极投资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。

7.3 期末指数投资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 | 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 |

7.4 报告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 | 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 |
| 11 | 000937 | 金牛能源 | 220,690 | 8,540,703.00 | 1.82 |
| 12 | 600348 | 国阳新能 | 267,201 | 8,112,222.36 | 1.73 |
| 13 | 600642 | 申能股份 | 810,803 | 7,994,517.58 | 1.70 |
| 14 | 000709 | 唐钢股份 | 1,016,989 | 7,952,853.98 | 1.69 |
| 15 | 600177 | 雅戈尔 | 563,364 | 7,768,789.56 | 1.66 |
| 16 | 000630 | 铜陵有色 | 363,030 | 7,619,999.70 | 1.62 |
| 17 | 000878 | 云南铜业 | 352,493 | 7,606,798.94 | 1.62 |
| 18 | 000800 | 一汽轿车 | 456,194 | 7,043,635.36 | 1.50 |
| 19 | 600808 | 马钢股份 | 1,339,671 | 6,484,007.64 | 1.38 |
| 20 | 600997 | 开滦股份 | 345,954 | 6,465,880.26 | 1.38 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 21 | 000895 | 双汇发展 | 172,317 | 6,203,412.00 | 1.32 |
| 22 | 600196 | 复星医药 | 416,444 | 6,034,273.56 | 1.29 |
| 23 | 600010 | 包钢股份 | 1,442,025 | 5,710,419.00 | 1.22 |
| 24 | 600331 | 宏达股份 | 347,535 | 5,522,331.15 | 1.18 |
| 25 | 600153 | 建发股份 | 398,549 | 5,392,367.97 | 1.15 |
| 26 | 600188 | 兖州煤业 | 332,028 | 5,179,636.80 | 1.10 |
| 27 | 600598 | 北大荒 | 384,478 | 4,894,404.94 | 1.04 |
| 28 | 600500 | 中化国际 | 402,450 | 4,781,106.00 | 1.02 |
| 29 | 000039 | 中集集团 | 483,747 | 4,755,233.01 | 1.01 |
| 30 | 600660 | 福耀玻璃 | 561,920 | 4,613,363.20 | 0.98 |
| 31 | 600026 | 中海发展 | 354,432 | 4,575,717.12 | 0.98 |
| 32 | 600058 | 五矿发展 | 240,539 | 4,399,458.31 | 0.94 |
| 33 | 600497 | 驰宏锌锗 | 218,828 | 4,330,606.12 | 0.92 |
| 34 | 000027 | 深圳能源 | 371,064 | 4,141,074.24 | 0.88 |
| 35 | 000959 | 首钢股份 | 665,759 | 4,007,869.18 | 0.85 |
| 36 | 600428 | 中远航运 | 367,369 | 3,809,616.53 | 0.81 |
| 37 | 000680 | 山推股份 | 340,501 | 3,748,916.01 | 0.80 |
| 38 | 600886 | 国投电力 | 354,984 | 3,702,483.12 | 0.79 |
| 39 | 600096 | 云天化 | 165,585 | 3,702,480.60 | 0.79 |
| 40 | 600269 | 赣粤高速 | 327,347 | 3,581,176.18 | 0.76 |
| 41 | 000422 | 湖北宜化 | 304,186 | 3,482,929.70 | 0.74 |
| 42 | 000012 | 南玻A | 217,377 | 3,406,297.59 | 0.73 |
| 43 | 000778 | 新兴铸管 | 394,974 | 3,361,228.74 | 0.72 |
| 44 | 600170 | 上海建工 | 199,534 | 3,352,171.20 | 0.71 |
| 45 | 600008 | 首创股份 | 493,626 | 3,233,250.30 | 0.69 |
| 46 | 600022 | 济南钢铁 | 700,969 | 3,189,408.95 | 0.68 |
| 47 | 000539 | 粤电力A | 447,590 | 3,151,033.60 | 0.67 |
| 48 | 000807 | 云铝股份 | 354,534 | 3,027,720.36 | 0.65 |
| 49 | 000089 | 深圳机场 | 379,498 | 2,929,724.56 | 0.62 |
| 50 | 000900 | 现代投资 | 156,626 | 2,864,689.54 | 0.61 |
| 51 | 000021 | 长城开发 | 246,484 | 2,760,620.80 | 0.59 |
| 52 | 600377 | 宁沪高速 | 428,203 | 2,719,089.05 | 0.58 |
| 53 | 002001 | 新和成 | 76,712 | 2,669,577.60 | 0.57 |
| 54 | 600064 | 南京高科 | 134,846 | 2,621,406.24 | 0.56 |
| 55 | 600588 | 用友软件 | 136,084 | 2,584,235.16 | 0.55 |
| 56 | 600418 | 江淮汽车 | 433,910 | 2,538,373.50 | 0.54 |
| 57 | 600066 | 宇通客车 | 204,201 | 2,503,504.26 | 0.53 |
| 58 | 600533 | 栖霞建设 | 352,732 | 2,433,850.80 | 0.52 |
| 59 | 600569 | 安阳钢铁 | 536,707 | 2,382,979.08 | 0.51 |
| 60 | 000541 | 佛山照明 | 295,967 | 2,364,776.33 | 0.50 |
| 61 | 600641 | 万业企业 | 225,603 | 2,260,542.06 | 0.48 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 62 | 600098 | 广州控股 | 346,276 | 2,250,794.00 | 0.48 |
| 63 | 600033 | 福建高速 | 331,698 | 2,222,376.60 | 0.47 |
| 64 | 600350 | 山东高速 | 377,427 | 2,121,139.74 | 0.45 |
| 65 | 600006 | 东风汽车 | 448,410 | 2,116,495.20 | 0.45 |
| 66 | 000726 | 鲁泰A | 247,628 | 2,104,838.00 | 0.45 |
| 67 | 600621 | 上海金陵 | 234,813 | 2,075,746.92 | 0.44 |
| 68 | 000088 | 盐田港 | 279,469 | 2,059,686.53 | 0.44 |
| 69 | 600308 | 华泰股份 | 184,604 | 1,982,646.96 | 0.42 |
| 70 | 600754 | 锦江股份 | 100,238 | 1,910,536.28 | 0.41 |
| 71 | 000830 | 鲁西化工 | 351,735 | 1,783,296.45 | 0.38 |
| 72 | 000912 | 泸天化 | 164,058 | 1,743,936.54 | 0.37 |
| 73 | 600102 | 莱钢股份 | 155,011 | 1,706,671.11 | 0.36 |
| 74 | 600863 | 内蒙华电 | 332,636 | 1,696,443.60 | 0.36 |
| 75 | 000559 | 万向钱潮 | 230,407 | 1,670,450.75 | 0.36 |
| 76 | 600270 | 外运发展 | 203,142 | 1,625,136.00 | 0.35 |
| 77 | 600409 | 三友化工 | 263,073 | 1,488,993.18 | 0.32 |
| 78 | 600388 | 龙净环保 | 69,901 | 1,453,241.79 | 0.31 |
| 79 | 000903 | 云内动力 | 148,417 | 1,451,518.26 | 0.31 |
| 80 | 000911 | 南宁糖业 | 96,452 | 1,447,744.52 | 0.31 |
| 81 | 000554 | 泰山石油 | 215,815 | 1,424,379.00 | 0.30 |
| 82 | 000828 | 东莞控股 | 233,435 | 1,346,919.95 | 0.29 |
| 83 | 000767 | 漳泽电力 | 297,330 | 1,317,171.90 | 0.28 |
| 84 | 600626 | 申达股份 | 186,120 | 1,304,701.20 | 0.28 |
| 85 | 600510 | 黑牡丹 | 133,481 | 1,229,360.01 | 0.26 |
| 86 | 600226 | 升华拜克 | 105,988 | 1,177,526.68 | 0.25 |
| 87 | 600035 | 楚天高速 | 208,986 | 1,159,872.30 | 0.25 |
| 88 | 000916 | 华北高速 | 244,686 | 1,159,811.64 | 0.25 |
| 89 | 600160 | 巨化股份 | 155,879 | 1,153,504.60 | 0.25 |
| 90 | 600126 | 杭钢股份 | 185,105 | 1,151,353.10 | 0.25 |
| 91 | 600120 | 浙江东方 | 167,108 | 1,101,241.72 | 0.23 |
| 92 | 600012 | 皖通高速 | 196,289 | 1,056,034.82 | 0.23 |
| 93 | 000429 | 粤高速A | 202,756 | 1,052,303.64 | 0.22 |
| 94 | 600798 | 宁波海运 | 195,391 | 1,039,480.12 | 0.22 |
| 95 | 000989 | 九芝堂 | 99,842 | 1,020,385.24 | 0.22 |
| 96 | 600197 | 伊力特 | 123,813 | 1,014,028.47 | 0.22 |
| 97 | 600578 | 京能热电 | 96,268 | 952,090.52 | 0.20 |
| 98 | 000919 | 金陵药业 | 112,874 | 948,141.60 | 0.20 |
| 99 | 600548 | 深高速 | 161,139 | 947,497.32 | 0.20 |
| 100 | 000155 | 川化股份 | 105,482 | 895,542.18 | 0.19 |

7.4.1 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。

7.4.2 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 |

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 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 | 601006 | 大秦铁路 | 51,291,352.63 | 5.66 |
| 2 | 600019 | 宝钢股份 | 44,627,161.82 | 4.92 |
| 3 | 600005 | 武钢股份 | 34,448,670.21 | 3.80 |
| 4 | 600011 | 华能国际 | 33,514,732.07 | 3.70 |
| 5 | 000983 | 西山煤电 | 31,147,236.73 | 3.44 |
| 6 | 000792 | 盐湖钾肥 | 30,873,687.34 | 3.41 |
| 7 | 000898 | 鞍钢股份 | 25,641,615.64 | 2.83 |
| 8 | 000825 | 太钢不锈 | 22,090,904.94 | 2.44 |
| 9 | 600642 | 申能股份 | 16,886,597.93 | 1.86 |
| 10 | 600104 | 上海汽车 | 16,518,485.99 | 1.82 |
| 11 | 600177 | 雅戈尔 | 16,480,861.77 | 1.82 |
| 12 | 000895 | 双汇发展 | 16,117,216.90 | 1.78 |
| 13 | 600598 | 北大荒 | 14,766,917.86 | 1.63 |
| 14 | 000937 | 金牛能源 | 14,352,128.07 | 1.58 |
| 15 | 000709 | 唐钢股份 | 14,338,024.96 | 1.58 |
| 16 | 600196 | 复星医药 | 14,176,842.39 | 1.56 |
| 17 | 600808 | 马钢股份 | 14,099,203.48 | 1.56 |
| 18 | 000800 | 一汽轿车 | 13,187,476.19 | 1.45 |
| 19 | 000060 | 中金岭南 | 13,052,726.70 | 1.44 |
| 20 | 600010 | 宝钢股份 | 12,632,082.59 | 1.39 |

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。

7.5.2 累计卖出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 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 601006 | 大秦铁路 | 40,510,729.23 | 4.47 |
| 2 | 600019 | 宝钢股份 | 36,338,484.91 | 4.01 |
| 3 | 002038 | 双鹭药业 | 33,512,535.16 | 3.70 |
| 4 | 600011 | 华能国际 | 25,048,752.10 | 2.76 |
| 5 | 000983 | 西山煤电 | 24,869,304.66 | 2.74 |
| 6 | 600005 | 武钢股份 | 24,709,597.68 | 2.73 |
| 7 | 000792 | 盐湖钾肥 | 22,061,706.62 | 2.43 |
| 8 | 000825 | 太钢不锈 | 18,609,265.98 | 2.05 |
| 9 | 000898 | 鞍钢股份 | 18,543,385.77 | 2.05 |
| 10 | 600104 | 上海汽车 | 14,346,644.43 | 1.58 |
| 11 | 600642 | 申能股份 | 13,256,074.01 | 1.46 |
| 12 | 600177 | 雅戈尔 | 12,906,411.58 | 1.42 |
| 13 | 000709 | 唐钢股份 | 12,209,941.87 | 1.35 |
| 14 | 000937 | 金牛能源 | 11,108,338.80 | 1.23 |
| 15 | 000878 | 云南铜业 | 11,064,246.14 | 1.22 |
| 16 | 600196 | 复星医药 | 10,569,329.00 | 1.17 |
| 17 | 000800 | 一汽轿车 | 10,438,962.75 | 1.15 |
| 18 | 000060 | 中金岭南 | 10,151,897.84 | 1.12 |
| 19 | 600808 | 马钢股份 | 10,128,647.90 | 1.12 |
| 20 | 600348 | 国阳新能 | 9,830,203.87 | 1.08 |

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。

7.5.3 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 | 924,740,360.45 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 742,364,973.74 |

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。

7.6 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 | 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 |

7.7 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 | 098052 | 09 轻纺城 | 100,000 | 10,081,000.00 | 2.15 |

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

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。

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。

7.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|------------|
| 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 |

7.10.4 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。

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

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(%) |
| 11743 | 28,471.08 | 150,500,244.77 | 45.01 | 183,835,619.81 | 54.99 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例(%) |
|----------------|-----------|-------------|
| 基金管理公司所有从业人员持有 | 18,665.00 | 0.0056 |

| | | |
|--------|--|--|
| 本开放式基金 | | |
|--------|--|--|

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|-----------------|
| 基金合同生效日（2008年11月20日）基金份额总额 | 500,000,000.00 |
| 报告期期初基金份额总额 | 905,559,026.38 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 364,710,993.73 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | -935,934,155.53 |
| 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 |

§ 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

本报告期内经中国证监会核准，本基金基金管理人于2009年6月4日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上公告聘任孟朝霞女士担任公司副总经理。

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。

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。

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，原安永大华会计师事务所有限责任公司更名为安永华明会计师事务所。

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、托管人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。

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 (%) | |
| 国泰君安 | 2 | 33,815,715.16 | 2.03 | — | — | — | — | — | — | 27,475.35 | 1.97 | — |
| 海通证券 | 1 | 986,602,163.33 | 59.18 | — | — | — | — | — | — | 838,611.76 | 60.27 | — |
| 申银万国 | 2 | 646,403,955.70 | 38.77 | — | — | — | — | — | — | 525,208.80 | 37.74 | — |
| 招商证券 | 1 | 283,500.00 | 0.02 | 198,243,757.89 | 100.00 | 1,850,000,000.00 | 100.00 | — | — | 240.98 | 0.02 | — |

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 | 富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金开放申购、赎回业务公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2009年01月20日 |
| 2 | 富国基金管理有限公司关于恢复旗下基金产品持有的唐钢股份股票市价估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2009年01月05日 |
| 3 | 富国基金管理有限公司关于旗下基金持有的盐湖钾肥股票复牌后估值方法调整的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2009年01月07日 |
| 4 | 富国基金管理有限公司关于恢复旗下基金持有的长江电力股票市价估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2009年05月19日 |

§ 11 备查文件目录

11.1 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

11.2 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、6层

11.3 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08月27日