

富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金

2009 年第 3 季度报告

2009 年 09 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 10 月 28 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 10 月 26 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 7 月 1 日起至 2009 年 9 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）	647,528,380.01
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7月1日到2009年9月30日)
1. 本期已实现收益	12,369,625.52
2. 本期利润	-133,445,853.00
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2429
4. 期末基金资产净值	878,553,080.70
5. 期末基金份额净值	1.357

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	-3.35%	2.55%	-1.59%	2.54%	-1.76%	0.01%

注：过去三个月指2009年7月1日—2009年9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9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合规守信情况说明

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2季度报告中我们指出，中国经济复苏的趋势已经非常明确，并且在可以预见的未来1个季度内具有持续性，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。

从目前来看，披露的宏观数据反映的经济状况确实如此，但投资者3季度中只享受到了7月份一个月上涨的快乐。8月、9月的市场下跌一方面是对前期高涨的乐观情绪中快速上涨的修正，另一方面是流动性不能维持上半年动辄上万亿的月度贷款数据。

展望4季度，市场面临相对较好的环境，一是市场已经经过了较为充分的调整，二是积极的刺激经济的措施维持不变，流动性不会更差，三是实体经济开始显现经济刺激政策的成果。简而言之，中国的经济复苏仍在过程中，证券市场面临较好的外部环境。

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。在本报告期内，在跟踪的策略上，本基金基本上采取了完全复制的策略。但是在本报告期内，本基金经历到了今年以来最为严重的申购赎回冲击，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，对跟踪效果产生了较大影响。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。

§ 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	796,653,714.78	89.93
	其中：股票	796,653,714.78	89.93
2	固定收益投资	10,144,909.40	1.15
	其中：债券	10,144,909.40	1.15
	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	75,574,216.92	8.53
6	其他资产	3,525,116.26	0.40
7	合计	885,897,957.36	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	28,195.00	0.00
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	11,445.00	0.00
C8	医药、生物制品	16,750.00	0.00
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	30,709.68	0.00
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	11,780.00	0.00
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	70,684.68	0.01

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	8,637,346.40	0.98
B	采掘业	102,596,757.65	11.68
C	制造业	452,936,623.97	51.55
C0	食品、饮料	18,879,190.71	2.15
C1	纺织、服装、皮毛	22,928,926.87	2.61
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	7,872,811.52	0.90
C4	石油、化学、塑胶、塑料	70,077,025.29	7.98
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	241,900,967.24	27.53
C7	机械、设备、仪表	75,181,925.89	8.56
C8	医药、生物制品	16,095,776.45	1.83
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	66,399,240.51	7.56
E	建筑业	5,162,348.76	0.59
F	交通运输、仓储业	95,605,211.24	10.88
G	信息技术业	13,062,594.25	1.49
H	批发和零售贸易	27,895,228.29	3.18
I	金融、保险业	—	—
J	房地产业	11,775,073.12	1.34
K	社会服务业	12,512,605.91	1.42
L	传播与文化产业	—	—

M	综合类	—	—
	合计	796,583,030.10	90.67

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	000983	西山煤电	1,247,025	39,044,352.75	4.44
2	601006	大秦铁路	4,017,227	37,239,694.29	4.24
3	600019	宝钢股份	5,397,928	34,870,614.88	3.97
4	600104	上海汽车	1,354,705	26,755,423.75	3.05
5	000792	盐湖钾肥	477,545	23,700,558.35	2.70
6	600005	武钢股份	3,286,311	22,774,135.23	2.59
7	000898	鞍钢股份	1,881,878	21,340,496.52	2.43
8	000825	太钢不锈	2,904,135	20,387,027.70	2.32
9	600011	华能国际	2,854,461	20,181,039.27	2.30
10	600348	国阳新能	498,651	17,761,948.62	2.02

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

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	002115	三维通信	1,592	30,709.68	0.00
2	601888	中国国旅	1,000	11,780.00	0.00
3	300004	南风股份	500	11,445.00	0.00
4	300009	安科生物	500	8,500.00	0.00
5	300006	莱美药业	500	8,250.00	0.00

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

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	000983	西山煤电	1,247,025	39,044,352.75	4.44
2	601006	大秦铁路	4,017,227	37,239,694.29	4.24
3	600019	宝钢股份	5,397,928	34,870,614.88	3.97
4	600104	上海汽车	1,354,705	26,755,423.75	3.05
5	000792	盐湖钾肥	477,545	23,700,558.35	2.70

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	10,116,000.00	1.15
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	28,909.40	0.00
7	其他	—	—
8	合计	10,144,909.40	1.15

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	10,116,000.00	1.15
2	110007	博汇转债	260	28,909.40	0.00

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	415,715.35
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	202,879.93
5	应收申购款	2,891,682.20
6	其他应收款	—

7	待摊费用	14,838.78
8	其他	—
9	合计	3,525,116.26

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	334,335,864.58
报告期期间基金总申购份额	742,098,210.03
报告期期间基金总赎回份额	428,905,694.60
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	647,528,380.01

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

根据《证券投资基金法》、《深圳证券交易所创业板股票上市规则》和《创业板市场投资者适当性管理暂行规定》其配套文件及中国证监会基金部函【2009】636号《关于证券投资基金投资创业板上市证券的说明》的相关规定，本基金将参与创业板上市的股票和可转换债券的投资，并严格按照公司制度流程规定进行投资决策和风险管理，同时于2009年9月23日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上做相关公告。

§ 8 备查文件目录

8.1 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

8.2 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

8.3 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 10 月 28 日