

富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金

2011 年第 3 季度报告

2011 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： 2011 年 10 月 26 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 2011 年 10 月 24 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 2011 年 7 月 1 日起至 2011 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	富国天鼎中证指数增强
基金主代码	100032
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）	797,471,031.66
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。
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	报告期(2011年07月01日-2011年09月30日)
1. 本期已实现收益	-35,914,918.07
2. 本期利润	-128,064,379.08
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1607
4. 期末基金资产净值	836,957,456.03
5. 期末基金份额净值	1.050

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	-13.58%	1.20%	-12.84%	1.16%	-0.74%	0.04%

注：过去三个月指 2011 年 7 月 1 日—2011 年 9 月 30 日

3.2.2 自基金转型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 2011 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		
徐幼华	本基金基金经理	2011-05-13	—	7 年	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理；2006 年 7 月至 2008 年 12 月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员，2009 年 1 月至 2011 年 5 月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员、基金经理助理，2011 年 5 月起任富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金基金经理。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 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 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

回顾 2011 年三季度，宏观调控政策仍然未见放松迹象，欧美主权债务危机升级使得外围经济动荡加剧。整个三季度市场表现持续疲软，震荡下行，市场呈现普跌格局，风格上表现分化并不明显。在收益表现上，中证红利指数收益为 -14.29%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行指数增强和风险管理，由于内外市场的较大波动，量化增强策略的超额收益在季度后期出现较大回撤，报告期内，本基金的超额收益为 -0.74%。本基金在报告期内遇到多次申购赎回，在一定程度上增加了本基金的交易成本。

展望 2011 年四季度，国内经济仍然存在一定的下行压力，但宏观政策可能不会再进一步收紧，市场资金面环境将逐渐转好。欧美主权债务危机可能引发新的国际金融风险已经得到很大程度的释放，欧美政府的救援政策将逐渐生效，使得外围经济困境得到一定缓解。鉴于目前市场点位已经充分体现了经济悲观的预期，市场继续下行的空间有限，预计四季度 A 股市场向上的概率增加。综合来看，四季度市场可能会呈现区间震荡向上走势。

在投资管理上，我们将继续发挥量化团队优势，以获取更好的业绩回报投资者。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金净值增长率为 -13.58%，业绩比较基准收益率为 -12.84%。

§ 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	756,288,131.76	89.86
	其中：股票	756,288,131.76	89.86
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	82,021,701.41	9.75
6	其他资产	3,357,238.82	0.40
7	合计	841,667,071.99	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	2,216,946.78	0.26
B	采掘业	2,468,327.60	0.29
C	制造业	80,169,400.35	9.58
C0	食品、饮料	8,987,073.50	1.07
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	10,429,708.64	1.25
C5	电子	2,939,137.00	0.35
C6	金属、非金属	24,291,832.94	2.90
C7	机械、设备、仪表	32,916,927.12	3.93
C8	医药、生物制品	604,721.15	0.07
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	580,393.32	0.07
F	交通运输、仓储业	531,115.42	0.06
G	信息技术业	834,156.00	0.10
H	批发和零售贸易	3,940,443.80	0.47
I	金融、保险业	46,707,774.38	5.58
J	房地产业	3,146,326.60	0.38
K	社会服务业	4,581,640.00	0.55
L	传播与文化产业	384,597.00	0.05

M	综合类	—	—
	合计	145,561,121.25	17.39

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	—	—
B	采掘业	137,020,577.12	16.37
C	制造业	186,320,734.83	22.26
C0	食品、饮料	8,422,759.80	1.01
C1	纺织、服装、皮毛	31,957,043.44	3.82
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	10,430,069.76	1.25
C4	石油、化学、塑胶、塑料	50,781,577.20	6.07
C5	电子	5,611,871.36	0.67
C6	金属、非金属	53,751,820.50	6.42
C7	机械、设备、仪表	9,675,073.92	1.16
C8	医药、生物制品	15,480,598.85	1.85
C99	其他制造业	209,920.00	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	28,777,162.20	3.44
E	建筑业	135,751.00	0.02
F	交通运输、仓储业	79,928,254.60	9.55
G	信息技术业	367,737.44	0.04
H	批发和零售贸易	24,650,701.60	2.95
I	金融、保险业	153,095,872.97	18.29
J	房地产业	147,978.75	0.02
K	社会服务业	—	—
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	282,240.00	0.03
	合计	610,727,010.51	72.97

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股票投资明细

5.4.1 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	601328	交通银行	17,133,719	76,759,061.12	9.17
2	601088	中国神华	2,919,080	73,969,487.20	8.84
3	601006	大秦铁路	5,767,552	41,353,347.84	4.94
4	601939	建设银行	7,195,860	31,661,784.00	3.78
5	600030	中信证券	2,782,291	31,300,773.75	3.74

6	000792	盐湖股份	685,917	29,768,797.80	3.56
7	600900	长江电力	4,402,700	27,560,902.00	3.29
8	601333	广深铁路	7,432,706	23,858,986.26	2.85
9	600153	建发股份	3,179,300	23,558,613.00	2.81
10	600160	巨化股份	995,392	20,863,416.32	2.49

5.4.2 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

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	600016	民生银行	4,036,436	22,281,126.72	2.66
2	600741	华域汽车	1,810,612	18,576,879.12	2.22
3	600362	江西铜业	375,093	10,014,983.10	1.20
4	600369	西南证券	769,440	8,171,452.80	0.98
5	000666	经纬纺机	687,627	7,756,432.56	0.93

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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	752,175.06
2	应收证券清算款	1,006,231.20
3	应收股利	367,948.95
4	应收利息	15,650.84
5	应收申购款	1,215,232.77
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,357,238.82

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

5.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五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	865,767,821.33
-------------	----------------

报告期期间基金总申购份额	68,525,945.79
减：报告期期间基金总赎回份额	136,822,735.46
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	797,471,031.66

§ 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

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17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
2011年10月26日