

# 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

(摘要)

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。

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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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

### 2.4 信息披露方式

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

## § 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

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（benchmarkt）按下列公式计算：

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

其中，t=1, 2, 3, ···, T, T表示时间截至日；

期间 T 日收益率 (benchmarkT) 按下列公式计算:

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

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遵规守信情况的说明

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 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管理人——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	本期末 (2009年06月30日)	上年度末 (2008年12月31日)
<b>资产：</b>		
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
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2009年06月30日)</b>	<b>上年度末 (2008年12月31日)</b>
<b>负债：</b>		
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
<b>所有者权益：</b>		
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。

## 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	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)
<b>一、收入</b>	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	—
<b>二、费用（以“-”号填列）</b>	-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	—
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	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。

### 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。

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

#### 6.4.1.1 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。

#### 6.4.1.2 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。

#### 6.4.1.3 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。

### 6.4.2 关联方关系

#### 6.4.2.1 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。

#### 6.4.2.2 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

### 6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.3.1.1 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。

##### 6.4.3.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未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。

#### 6.4.3.1.3 债券交易

注：本基金本报告期未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。

#### 6.4.3.1.4 回购交易

注：本基金本报告期未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。

#### 6.4.3.1.5 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。

#### 6.4.3.2 关联方报酬

##### 6.4.3.2.1 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。

##### 6.4.3.2.2 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。

#### 6.4.3.3 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。

#### 6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.3.4.1 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。

##### 6.4.3.4.2 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

#### 6.4.3.5 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。

#### 6.4.3.6 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。

#### 6.4.4 期末（2009 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.4.1 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。

##### 6.4.4.2 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	2009-07-27	60.65	225,004	10,859,042.96	12,406,720.56

##### 6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.4.3.1 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。

###### 6.4.4.3.2 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。

#### 6.4.5 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前十名投资明细

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

注：投资者欲了解本报告期末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

##### 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。

### 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	—

富国基金管理有限公司  
2009年08月27日