

富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金

二 00 九年年度报告

(摘要)

2009 年 12 月 31 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： 2010 年 03 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 2010 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期为 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日。

## § 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
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
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
报告期末基金份额总额	813,612,400.20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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2009 年	2008 年(自基金转型日 2008 年 11 月 20 日起至 2008 年 12 月 31 日)
本期已实现收益	210,991,226.74	-132,013,626.98
本期利润	302,474,637.49	16,878,942.80
加权平均基金份额本期利润	0.5187	0.0312
本期基金份额净值增长率	67.83%	2.99%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年 12 月 31 日	2008 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	0.4781	0.0875
期末基金资产净值	1,367,014,527.54	906,669,297.68
期末基金份额净值	1.680	1.001

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，封闭式基金交易佣金、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 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
过去三个月	23.80%	1.80%	23.45%	1.76%	0.35%	0.04%
过去六个月	19.66%	2.22%	21.48%	2.20%	-1.82%	0.02%
过去一年	67.83%	2.05%	95.27%	2.08%	-27.44%	-0.03%
自基金转型日 起至今	72.85%	1.94%	80.00%	2.07%	-7.15%	-0.13%

注：注：本基金转型日为 2008 年 11 月 20 日。

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）按下列公式计算：

↵

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

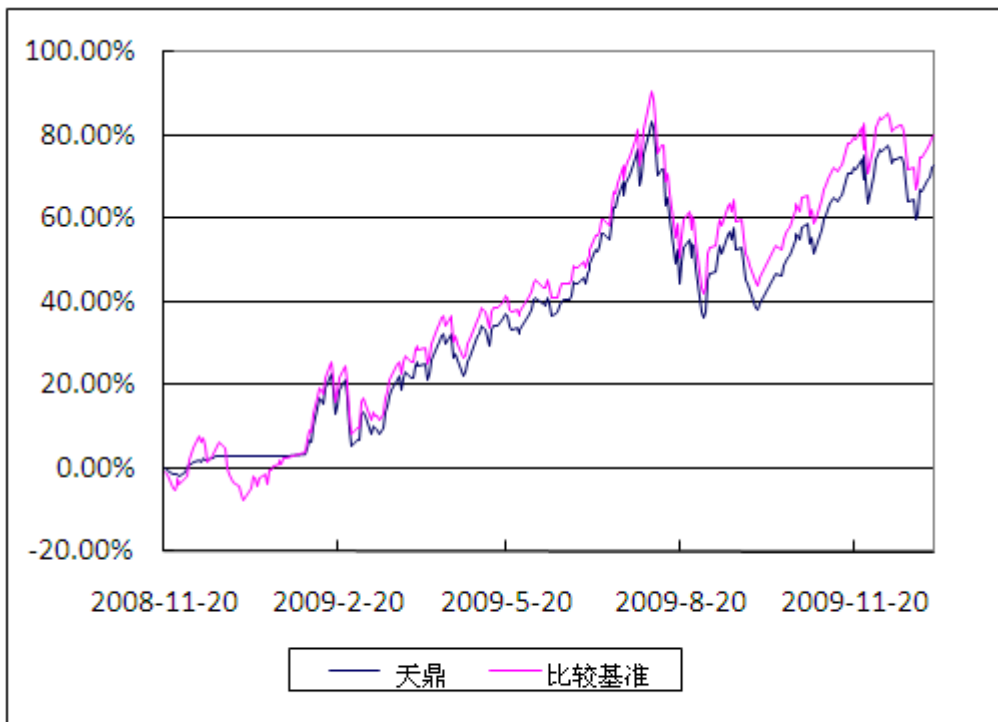
其中,  $t=1,2,3,\dots,T$ ,  $T$  表示时间截至日; ↵

期间  $T$  日收益率 ( $\text{benchmark}_T$ ) 按下列公式计算: ↵

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

其中,  $T=2,3,4,\dots$ ;  $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $t$  日至  $T$  日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  数学连乘。 ↵

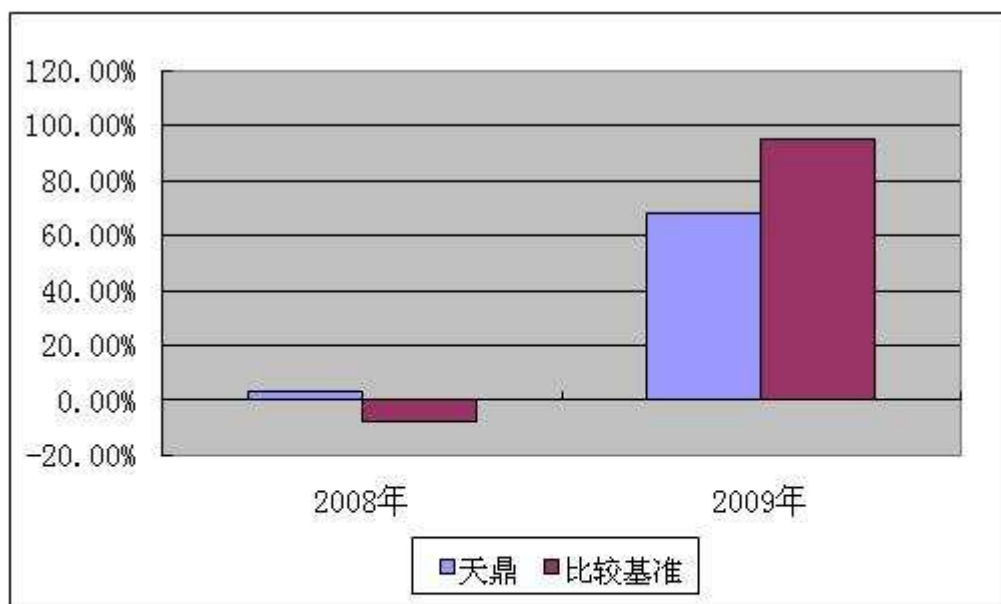
### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注: 1、本图中所示时间区间为 2008 年 11 月 20 日至 2009 年 12 月 31 日, 本基金自基金转型日起至图表截止日不足一年。

2、本基金转型日为 2008 年 11 月 20 日, 建仓期 6 个月, 即从 2008 年 11 月 20 日至 2009 年 5 月 19 日, 建仓期结束时本基金各项资产配置比例均符合基金合同的规定。

### 3.2.3 自基金转型以来每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金转型日为 2008 年 11 月 20 日。2008 年净值增长率按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009年	—	—	—	—	—
2008年	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

## § 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 12 月 31 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和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、富国优化增强债券型证券投资基金及富国沪深 300 增强证券投资基金十二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		
常松	本基金基金经理兼任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理。	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、富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
宋小龙	本基金前任基金经理。	2008-11-20	2010-01-27	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，2006 年 12 月至 2008 年 11 月任汉鼎基金经理；2008 年 11 月至 2010 年 1 月任富国天鼎基金经理；2007 年 6 月至今任富国天瑞基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

注：1、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。

2、本公司于 2010 年 1 月 27 日在中国证券报、上海证券报、证券时报做公告，免去宋小龙先生本基金基金经理职务，常松继续先生担任本基金基金经理。

#### 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原汉鼎证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《汉鼎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，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害

基金持有人利益的行为。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

##### **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**

注：本基金与本基金管理人旗下富国沪深 300 增强证券投资基金属相似投资风格的投资组合。因富国沪深 300 增强证券投资基金成立于 2009 年 12 月 16 日，根据相关规定免于披露 2009 年年度报告，故在此暂不列示上述两支基金的业绩比较。

##### **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**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2009 年，本基金的运作过程以 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。

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。

由于基金规模相对较小，机构占比高，本基金在 2009 年度经历了严重的申购赎回冲击，对跟踪效果造成了负面影响。冲击主要发生在 2009 年 1 季度和 2009 年 3 季度。1 季度主要是由于打开申购赎回后，在封转开过程中获利较大的投资者实现收益的需求。3 季度主要是 7 月份市场热度最高时大量的申购所造成。其中 7 月份是受申购赎回冲击最大的月份，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。除此之外的时间里本基金都完成了跟踪并超越指数的目标。



#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2009 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.680 元，份额累计净值为 1.891 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 67.83%，同期业绩比较基准收益率为 95.27%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，中国经济复苏已经得到确认，A 股市场目前估值水平处于历史平均水平。我们预计 2010 年 A 股市场将在基本面向上，政策面开始向下的背景下走出较为平稳的趋势。

需要提醒投资者注意的是，中证红利指数在 2010 年开始将大幅度调换样本股，调整的数量为 20 个股票，调整的权重超过组合 30%，使中证红利原来以钢铁、有色、化工等行业为代表的强周期性有所减弱，取而代之的是中证红利指数组合大幅度增加了银行股的配置，银行股占到组合 26% 的权重。但是，较之于沪深 300 指数，中证红利指数仍然在煤炭、化工、钢铁上占有更多的权重，而在房地产，以及除银行以外的金融股上权重较大幅度低于沪深 300 指数。

#### 4.6 管理人对报告期内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

本基金于 2010 年 1 月 11 日公告对 2009 年报告期内利润进行收益分配。本基金 2009 年年度可供分配收益为 388,960,352.03 元，每 10 份基金份额派发现金红利 2.45 元，本基金 2009 年共计派发红利 198,652,009.00 元，占年度可供分配收益的 51.07%。根据本基金《基金合同》约定：“本基金全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 50%；”，因此本基金本期分红已符合本基金合同的约定。

## § 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，本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》及其他有关法律法规、基金合同，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应尽的义务。

## 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

2009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基本按照有关法律法规、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。

2009年,富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金出现过新股申购无效的情况,我行及时向富国基金管理有限公司发送提示函件,富国基金管理有限公司在规定时间内及时对投资组合进行披露或调整,未给基金持有人造成损失。

## 5.3 托管人对本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

2010年3月25日

## § 6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。  
投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 (2009年12月31日)	上年度末 (2008年12月31日)
<b>资产:</b>		
银行存款	107,941,518.51	358,405,307.33
结算备付金	—	453,633.40
存出保证金	791,377.95	348,780.49
交易性金融资产	1,256,669,375.48	245,808,453.20
其中:股票投资	1,246,541,375.48	48,321,200.00
基金投资	—	—
债券投资	10,128,000.00	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	22,977,467.62	300,093,000.00
应收利息	303,352.53	1,939,682.21
应收股利	—	—
应收申购款	60,984,047.43	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	1,021,322.78
资产总计	1,449,667,139.52	908,070,179.41
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>(2009年12月31日)</b>	<b>(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	76,603,862.65	—
应付赎回款	3,041,026.03	—
应付管理人报酬	1,227,356.65	623,660.07
应付托管费	204,559.41	103,943.35
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	1,071,101.47	268,655.03
应交税费	42,474.93	42,474.93
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	462,230.84	362,148.35
负债合计	82,652,611.98	1,400,881.73
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	722,787,376.97	804,544,654.78
未分配利润	644,227,150.57	102,124,642.90
所有者权益合计	1,367,014,527.54	906,669,297.68
负债和所有者权益总计	1,449,667,139.52	908,070,179.41

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.680 元，基金份额总额 813,612,400.20 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2009年01月01日至2009 年12月31日)	上年度可比区间 (2008年11月20日(基 金转型日)至2008年 12月31日)
<b>一、收入</b>	320,236,258.54	18,438,039.59
1. 利息收入	1,766,434.66	1,140,598.06
其中：存款利息收入	720,490.02	169,967.86
债券利息收入	831,444.64	877,630.20
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	214,500.00	93,000.00
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	224,485,360.50	-131,595,867.70
其中：股票投资收益	212,661,408.34	-131,660,797.70
基金投资收益	—	—
债券投资收益	5,007,547.38	64,930.00
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	6,816,404.78	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	91,483,410.75	148,892,569.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,501,052.63	739.45
<b>减：二、费用</b>	17,761,621.05	1,559,096.79
1. 管理人报酬	9,696,455.35	818,979.77
2. 托管费	1,616,075.79	136,496.63
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	5,792,091.03	373,761.91
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	656,998.88	229,858.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	302,474,637.49	16,878,942.80
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	302,474,637.49	16,878,942.80

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2009年01月01日至2009年12月31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）	—	302,474,637.49	302,474,637.49
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）	-81,757,277.81	239,627,870.18	157,870,592.37
其中：1. 基金申购款	1,296,894,828.20	910,904,759.15	2,207,799,587.35
2. 基金赎回款	-1,378,652,106.01	-671,276,888.97	-2,049,928,994.98
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）	722,787,376.97	644,227,150.57	1,367,014,527.54
项目	上年度可比区间 (2008年11月20日(基金转型日)至2008年12月31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）	500,000,000.00	47,008,683.99	547,008,683.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	16,878,942.80	16,878,942.80
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）	304,544,654.78	38,237,016.11	342,781,670.89
其中：1. 基金申购款	304,544,654.78	38,237,016.11	342,781,670.89
2. 基金赎回款	—	—	—
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）	804,544,654.78	102,124,642.90	906,669,297.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

窦玉明	林志松	雷青松
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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及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，基金管理人对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）。

#### 7.4.2 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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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2号《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》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

#### 7.4.3 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12月31日的财务状况以及自2009年度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。

#### 7.4.4 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

#### 7.4.5 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。

7.4.6 关联方关系

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、注册登记机构、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
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
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。

#### 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.7.1.1 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12月31日)		上年度可比区间 (2008年11月20日(基金转型日)至 2008年12月31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	2,328,464,367.04	57.38	38,311,347.43	20.44
申银万国	1,626,923,942.78	40.09	42,577,883.97	22.71

###### 7.4.7.1.2 权证交易

注：本基金本期及其上期可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.7.1.3 债券交易

注：本基金本期及其上期可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.7.1.4 回购交易

注：本基金本期及其上期可比期间未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 7.4.7.1.5 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12月31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	1,979,191.45	58.35	579,036.70	54.06
申银万国	1,327,278.47	39.13	435,009.41	40.61
关联方名称	上年度可比期间(2008年11月20日(基金转型日)至2008年12月31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	32,564.10	20.81	60,522.04	22.53
申银万国	35,077.90	22.42	66,520.16	24.76

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。

##### 7.4.7.2 关联方报酬

###### 7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比区间 (2008年11月20日(基金转型
----	-----------------------------	------------------------------



		日)至 2008 年 12 月 31 日)
当期发生的基金应支付的管理费	9,696,455.35	818,979.77
其中: 支付销售机构的客户维护费	1,002,027.31	5,872.45

注: 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。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

管理人的管理费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 7.4.7.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 (2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日)	上年度可比区间 (2008 年 11 月 20 日 (基金转型日) 至 2008 年 12 月 31 日)
当期发生的基金应支付的托管费	1,616,075.79	136,496.63

注: 注: 基金托管费按前一日的基金资产净值的 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, 逐日累计至每月月底, 按月支付; 由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 7.4.7.3 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 2009 年度及自 2008 年 11 月 20 日 (基金转型日) 至 2008 年 12 月 31 日止期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购) 交易。

#### 7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.7.4.1 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 12 月 31 日)	上年度可比区间 (2008 年 11 月 20 日 (基金转型日) 至 2008 年 12 月 31 日)
基金转型日 (2008 年 11 月 20 日) 持有的基金份额	—	—
期初持有的基金份额	27,253,571.72	24,213,458.00
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	3,040,113.72
减: 期间赎回/卖出总份额	27,253,571.72	—
期末持有的基金份额	—	27,253,571.72
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	3.01%

7.4.7.4.2 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12月31日）		上期末（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	2,813,886.78	0.35	22,812,886.78	2.52

7.4.7.5 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12月31日）		上年度可比区间（2008年11月20日（基金转型日）至2008年12月31日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	107,941,518.51	671,076.57	358,405,307.33	169,129.29

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金2009年度及自2008年11月20日（基金转型日）至2008年12月31日止期间不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期末无其他关联交易事项的说明。

7.4.8 期末（2009年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.8.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601117	中国化学	2009-12-29	2010-01-07	新股认购	5.43	5.43	7,000	38,010.00	38,010.00	—

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	备注
600022	济南钢铁	2009-11-09	筹划重大事项	5.27	2010-02-24	5.00	1,521,179	8,350,428.96	8,016,613.33	—
600102	莱钢股份	2009-11-09	筹划重大事项	13.07	2010-02-24	11.88	339,711	4,145,127.66	4,440,022.77	—

### 7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购，未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无交易所市场债券正回购，未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.9 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	1,246,541,375.48	85.99
	其中：股票	1,246,541,375.48	85.99
2	固定收益投资	10,128,000.00	0.70
	其中：债券	10,128,000.00	0.70
	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	107,941,518.51	7.45
6	其他各项资产	85,056,245.53	5.87
7	合计	1,449,667,139.52	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	10,265,914.00	0.75
C	制造业	9,984,633.88	0.73
C0	食品、饮料	1,025,232.00	0.07
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	986,468.00	0.07

C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	—	—
C7	机械、设备、仪表	7,972,933.88	0.58
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	1,886,368.00	0.14
I	金融、保险业	7,911,550.00	0.58
J	房地产业	6,508,937.71	0.48
K	社会服务业	2,227,945.00	0.16
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	38,785,348.59	2.84

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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,700,640.00	0.56
B	采掘业	178,720,829.37	13.07
C	制造业	519,665,027.47	38.01
C0	食品、饮料	19,239,197.00	1.41
C1	纺织、服装、皮毛	60,047,083.44	4.39
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	23,345,133.84	1.71
C4	石油、化学、塑胶、塑料	72,155,245.68	5.28
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	258,297,849.82	18.90
C7	机械、设备、仪表	38,463,308.95	2.81
C8	医药、生物制品	48,117,208.74	3.52
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	95,209,272.58	6.96
E	建筑业	5,202,305.46	0.38
F	交通运输、仓储业	75,791,216.74	5.54
G	信息技术业	18,617,864.85	1.36
H	批发和零售贸易	59,223,344.89	4.33
I	金融、保险业	243,915,311.55	17.84
J	房地产业	3,710,213.98	0.27

K	社会服务业	—	—
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	1,207,756,026.89	88.35

### 8.3 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

#### 8.3.1 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	13,995,053	130,853,745.55	9.57
2	600019	宝钢股份	6,830,628	65,983,866.48	4.83
3	600177	雅戈尔	3,754,494	54,477,707.94	3.99
4	601939	建设银行	8,790,400	54,412,576.00	3.98
5	601988	中国银行	12,298,000	53,250,340.00	3.90
6	601006	大秦铁路	4,261,847	43,897,024.10	3.21
7	000983	西山煤电	1,092,330	43,573,043.70	3.19
8	601857	中国石油	2,657,600	36,728,032.00	2.69
9	600058	五矿发展	1,885,728	36,620,837.76	2.68
10	600011	华能国际	4,382,386	35,102,911.86	2.57

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年度报告正文

#### 8.3.2 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	218,800	6,951,276.00	0.51
2	000006	深振业A	574,487	6,508,937.71	0.48
3	601088	中国神华	181,900	6,333,758.00	0.46
4	600835	上海机电	453,891	6,209,228.88	0.45
5	601899	紫金矿业	407,900	3,932,156.00	0.29

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年度报告正文

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	601328	交通银行	122,146,327.41	13.47
2	600019	宝钢股份	98,856,022.35	10.90
3	601006	大秦铁路	94,246,422.98	10.39
4	000983	西山煤电	75,834,336.17	8.36
5	600177	雅戈尔	71,133,955.96	7.85
6	600011	华能国际	67,922,653.80	7.49
7	600005	武钢股份	65,582,215.96	7.23
8	000792	盐湖钾肥	59,866,875.63	6.60
9	000898	鞍钢股份	53,784,441.90	5.93
10	601939	建设银行	52,839,265.25	5.83
11	601988	中国银行	52,143,533.51	5.75
12	000825	太钢不锈	50,588,675.23	5.58
13	600058	五矿发展	48,477,162.66	5.35
14	600348	国阳新能	42,159,662.25	4.65
15	600104	上海汽车	41,661,803.21	4.60
16	000039	中集集团	38,007,096.50	4.19
17	601857	中国石油	35,888,768.07	3.96
18	600642	申能股份	34,871,414.33	3.85
19	000878	云南铜业	32,223,632.61	3.55
20	000060	中金岭南	32,144,509.16	3.55
21	000539	粤电力A	31,954,673.15	3.52
22	000937	金牛能源	31,530,859.72	3.48
23	000709	唐钢股份	30,972,455.54	3.42
24	600196	复星医药	29,308,965.96	3.23
25	600808	马钢股份	27,584,439.42	3.04
26	000895	双汇发展	27,445,520.63	3.03
27	000800	一汽轿车	27,238,326.17	3.00
28	000912	泸天化	26,527,019.62	2.93
29	600010	宝钢股份	25,814,364.17	2.85
30	600308	华泰股份	25,601,060.55	2.82
31	600598	北大荒	24,603,852.23	2.71
32	600997	开滦股份	24,577,561.23	2.71

33	600153	建发股份	24,084,920.74	2.66
34	000630	铜陵有色	23,977,716.07	2.64
35	600664	哈药股份	23,622,948.42	2.61
36	000021	长城开发	23,590,402.21	2.60
37	600188	兖州煤业	23,362,430.75	2.58
38	600026	中海发展	22,299,413.87	2.46
39	600500	中化国际	20,831,225.01	2.30
40	000778	新兴铸管	20,525,894.84	2.26
41	600660	福耀玻璃	20,434,827.86	2.25
42	600331	宏达股份	20,429,197.73	2.25
43	600497	驰宏锌锗	19,062,164.79	2.10
44	000422	湖北宜化	18,948,935.89	2.09
45	000027	深圳能源	18,791,250.50	2.07

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。

#### 8.4.2 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	600104	上海汽车	64,356,295.86	7.10
2	601006	大秦铁路	59,189,984.17	6.53
3	600019	宝钢股份	55,807,546.52	6.16
4	000983	西山煤电	53,660,625.57	5.92
5	600005	武钢股份	47,070,076.39	5.19
6	000792	盐湖钾肥	43,206,517.33	4.77
7	000825	太钢不锈	40,570,922.97	4.47
8	000878	云南铜业	39,655,370.04	4.37
9	000060	中金岭南	38,906,902.28	4.29
10	600011	华能国际	35,027,194.76	3.86
11	000898	鞍钢股份	34,967,840.71	3.86
12	002038	双鹭药业	33,512,535.16	3.70
13	000709	唐钢股份	32,990,801.77	3.64
14	000937	金牛能源	26,913,647.73	2.97
15	600331	宏达股份	25,073,590.38	2.77
16	000800	一汽轿车	24,853,832.26	2.74
17	600642	申能股份	22,755,231.08	2.51
18	600808	马钢股份	21,284,683.53	2.35
19	600177	雅戈尔	20,638,877.61	2.28
20	600997	开滦股份	20,351,124.68	2.24
21	600010	包钢股份	19,913,061.43	2.20
22	600660	福耀玻璃	19,787,983.75	2.18

23	600348	国阳新能	19,386,818.10	2.14
24	000895	双汇发展	18,979,612.65	2.09

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。

#### 8.4.3 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	2,478,317,087.84
卖出股票收入（成交）总额	1,590,536,858.82

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。

#### 8.5 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	10,128,000.00	0.74
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	—	—
7	其他	—	—
8	合计	10,128,000.00	0.74

#### 8.6 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	10,128,000.00	0.74

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

报告期初至基金转型前最后一日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。



### 8.9.2 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。

报告期初至基金转型前最后一日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。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	791,377.95
2	应收证券清算款	22,977,467.62
3	应收股利	—
4	应收利息	303,352.53
5	应收申购款	60,984,047.43
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	85,056,245.53

### 8.9.4 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。

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.9.5.1 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。

#### 8.9.5.2 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。

### 8.9.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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(%)
26939	30,202.03	380,510,657.74	46.77	433,101,742.46	53.23

## 9.2 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本开放式基金	236,299.85	0.0290

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金转型日(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
本报告期基金总申购份额	1,459,893,254.17
减：本报告期基金总赎回份额	1,551,839,880.35
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	813,612,400.20

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 11.5 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，本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为8万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为7年。

### 11.6 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。

### 11.7 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	46,270,186.90	1.14	—	—	—	—	—	—	37,594.57	1.11	—
海通证券	1	2,328,464,367.04	57.38	—	—	—	—	—	—	1,979,191.45	58.35	—
申银万国	2	1,626,923,942.78	40.09	—	—	—	—	—	—	1,327,278.47	39.13	—
招商证券	1	56,304,131.04	1.39	198,617,009.57	100.00	1,850,000,000.00	100.00	—	—	47,858.52	1.41	—

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本期内本基金租用券商交易单元无变更。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金无影响投资者决策的其他重要事项。