富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金(原汉鼎证券投资基金转型) 2008年年度报告摘要

2008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:二00九年三月三十一日

§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2009年3月27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。

富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金由原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号核准,汉鼎证券投资基金由封闭式基金转型为开放式基金,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,汉鼎证券投资基金在上海证券交易所终止上市,其由《汉鼎证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金基金合同》正式生效。原汉鼎证券投资基金报告期为2008年1月1日至2008年11月19日,富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金报告期为2008年11月20日至2008年12月31日。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 转型前基金(原汉鼎证券投资基金)基本情况

基金简称	基金汉鼎
交易代码	500025
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2000年6月30日
报告期末基金份额总额	500,000,000.00份
基金合同存续期	至2008年12月31日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2000年8月17日

注:转型前基金终止上市日期为2008年11月20日。

2.1.2 转型后基金(富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金)基本情况

基金简称	富国天鼎
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	905,559,026.38份

2.2 基金产品说明

2.2.1 转型前基金(原汉鼎证券投资基金)产品说明

投资目标	通过注重投资符合国家产业发展方向的信息技术以及运用信息技术对传统产业进行改造,提升经营效率的上市公司,从而实现长期资本增值,充分注重投资组合的成长性并兼顾流动性,同时通过投资组合等措施减少和分散投资风险,确保基金资产的安全。
投资策略	本基金是积极成长型基金,遵守资产配置的均衡原则、适度集中、组合投资、坚持以基本面研究驱动投资的基础上注重波段操作,获取最大收益。

2.2.2 转型后基金(富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金)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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	转型后(2008年11月20日到2008年12月31日)	转型前(2008年1月1日到2008年11月19日)	2007年	2006年
本期已实现收益	-132,013,626.98	135,614,849.87	564,221,220.82	175,030,070.43
本期利润	16,878,942.80	-422,003,983.55	719,712,667.22	431,083,022.97
加权平均基金份额本期利润	0.0312	-0.8440	1.4394	0.8622
本期基金份额净值增长率	2.99%	-40.70%	89.28%	94.24%
3.1.2 期末数据和指标	转型后(2008年12月31日)	转型前(2008年11月19日)	2007年12月31日	2006年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0875	0.0940	0.8714	0.2415
期末基金资产净值	906,669,297.68	547,008,683.99	1,359,012,667.54	888,550,000.89
期末基金份额净值	1.001	1.0940	2.7180	1.7771

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 转型前基金(原汉鼎证券投资基金)净值表现

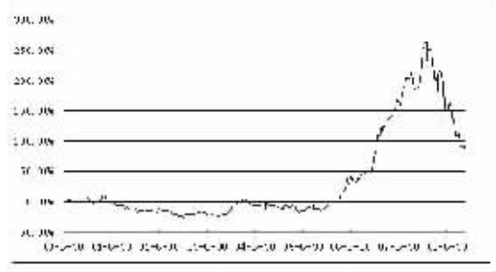
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2008年10月1日至2008年11月19日	-6.00%	4.11%	—	—	—	—
2008年7月1日至2008年11月19日	-15.34%	3.68%	—	—	—	—
2008年1月1日至2008年11月19日	-40.70%	4.09%	—	—	—	—
2006年1月1日至2008年11月19日	118.01%	3.53%	—	—	—	—
2004年1月1日至2008年11月19日	131.15%	3.09%	—	—	—	—
自基金合同生效起至2008年11月19日	100.55%	2.64%	—	—	—	—

注:由于基金汉鼎在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准,此表只列示基金的净值表现。

本基金自2008年11月20日起转型为开放式基金,2008年11月19日为本基金转型前最后一日,故将"过去三个月"、"过去六个月"、"过去一年"、"过去三年"、"过去五年"、"自基金合同生效起至今"等时间段相应地改为"2008年10月1日至2008年11月19日"、"2008年7月1日至2008年11月19日"、"2008年1月1日至2008年11月19日"、"2006年1月1日至2008年11月19日"、"2004年1月1日至2008年11月19日"、"自基金合同生效起至2008年11月19日"。

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

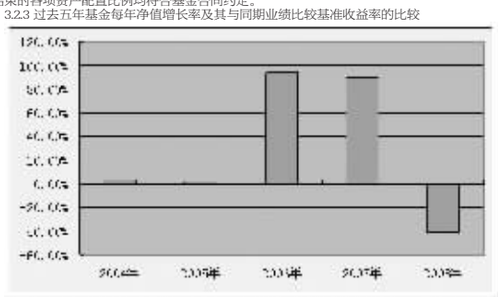


注:本图中所示时间区间为2000年6月30日至2008年11月19日。

由于本基金在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准,此图只列示基金的净值表现。

本基金于2000年6月30日成立,建仓期6个月,从2000年6月30日至2000年12月29日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金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:由于汉鼎证券投资基金在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准,此图只列示基金的净值表现。本基金于2008年11月20日转型为富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金,2008年所示时间区间为2008年1月1日至2008年11月19日。

3.3 转型后基金(富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金)净值表现

3.3.1 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
2008年11月20日至2008年12月31日	2.99%	0.43%	-7.82%	1.90%	10.81%	-1.47%

注:本基金合同于2008年11月20日生效,本基金报告期为2008年11月20日至2008年12月31日,不足一年。

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:

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

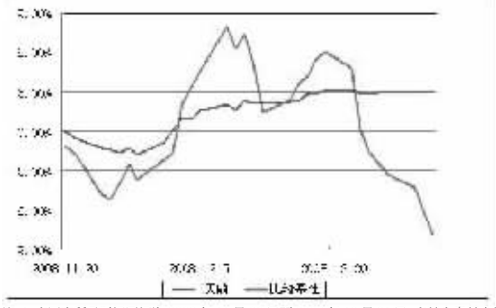
其中,t=1,2,3,···,T,T表示时间截至日;

期间T日收益率(benchmarkT)按下列公式计算:

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

其中,T=2,3,4,···;$\prod_{t=1}^{T}$(1+benchmarkt)表示t日至T日的(1+benchmarkt)数学连乘。

3.3.2 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



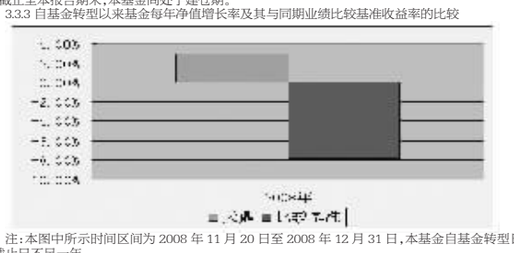
注:1、本图中所示时间区间为2008年11月20日至2008年12月31日,本基金自基金转型日至图表截止日不足一年。

2、2008年9月24日,汉鼎证券投资基金转型获基金份额持有人大会决议通过,并获中国证监会2008年11月11日证监许可[2008]1261号核准。自2008年11月20日起,汉鼎证券投资基金在上海证券交易所终止上市,其由《汉鼎证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金基金合同》正式生效。

3、富国基金管理有限公司已于2008年12月26日对投资者持有的原汉鼎证券投资基金(以下简称"基金汉鼎")进行了基金份额转换操作。经本基金托管人中国工商银行确认,拆分基准日(2008年12月26日)基金份额净值为1.126元,精确到小数点后第9位为1.125554710元(第9位以后舍去),本基金管理人按照1:1.125554710的转换比例将原基金汉鼎的基金财产进行了拆分。拆分后,基金份额净值变为1.000元,相应地,原基金汉鼎每1份基金份额转换为1.125554710份,基金份额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位舍去,所产生的误差归入基金财产。原基金汉鼎的基金总份额由500,000,000.00份转换为562,777,355.49份。

4、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,截止至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

3.3.3 自基金转型以来基金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:本图中所示时间区间为2008年11月20日至2008年12月31日,本基金自基金转型日至图表截止日不足一年。

3.4 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
转型后(2008年11月20日到2008年12月31日)	—	—	—	—	—
转型前(2008年1月1日到2008年11月19日)	7.800	390,000,000.00	—	390,000,000.00	—
2007年	4.985	249,250,000.57	—	249,250,000.57	—
2006年	—	—	—	—	—
合计	12.785	639,250,000.57	—	639,250,000.57	—

§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2008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及富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金十只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

原汉鼎证券投资基金:

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年12月19日	-	10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;汉鼎、天瑞基金经理,具有基金从业资格,中国国籍。

富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金:

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年12月19日	-	10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	本基金基金经理兼任金融数量工程部经理。	2008年11月20日	-	8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,现任金融数量工程部经理、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的说明

本基金在2008年度完成了封闭式基金转为开放式基金转型。转型时间界线为2008年11月20日。

汉鼎基金:截止到2008年11月19日,本基金期间净值增长率-40.70%。

天鼎基金:从2008年11月20日截止到2008年末,本基金在报告期内净值增长率2.99%。

从相对业绩来看,报告期内汉鼎排名尚可,但从绝对收益来看,亏损幅度较大。虽然宏观经济以及股票市场的系统性风险是造成基金资产大幅缩水的主要原因,但每当想起投资者的信任和支持,内心的愧疚之情还是难于抑制。

2008年全球以及中国的宏观经济可谓变幻莫测。上半年还是通胀高企,而下半年随着美国次贷危机对全球金融市场和实体经济冲击加深,以原油为代表的大宗原材料价格崩盘式下跌,通缩阴影竟然卷土重来。经济趋势演变速度之快、力度之大、幅度之深超出所有市场参与者的预期。

从市场表现来看,作为本基金作为重点投资的信息技术产业,在第一季度,这类公司市场表现相对强于大势,基金业绩表现相对尚可。而第二季度,市场全面下挫,"低仓位"成为市场唯一可以制胜的策略,本基金由于股票持仓比例相对为高,同时组合中又多是高β系数的股票,基金净值损失较高,业绩表现差强人意。第三季度,美国次贷危机愈演愈烈,投资者对全球宏观经济发展预期越来越趋于悲观,受国内经济发展不确定性的影响,A股市场持续下跌。作为本基金重点投资的电子信息技术产业,深受国际经济周期影响,行业景气度持续下降,股票价格随之下跌,导致本基金净值持续缩水,业绩表现一般。

第四季度,本基金的操作以调整为主,即将原来符合基金汉鼎契约的投资对象慢慢转换为符合富国天鼎基金契约的投资对象。也正是由于调整的过程,本基金的净值波动性从整个季度看来呈现出前高后低的特征。

在调整的过程中,本基金较好的抓住了11月份以来开始上涨时的机会,在市场流动性非常好的时候,以较低的交易成本基本完成了调出动作。并开始选择一些具有战略投资价值的中证红利样本股(包括2009年1月即将进入的样本股)开始逐步建仓。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们始终是一个长期的乐观主义者,展望2009年,对中国的经济发展抱有坚定的信心。对比目前A股市场的估值水平和中国经济增长的潜力,整个A股市场存在战略性投资机会。

2008年四季度的经济休克说明了中国经济周期性越来越强,我们认为,这种强周期性的经济特征也会使中国经济在复苏的过程中复苏的速度超出大部分人预期。

在经济快速恶化过程中,以本基金所跟踪的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。

基于这两点判断,我们认为在2009年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。

我们将努力工作,希望本基金持有人能够成为中国经济复苏过程中最为快乐的投资者。

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

本报告期,原汉鼎证券投资基金于2008年4月7日公告每10份基金单位派发现金红利7.60元,共计派发现金红利380,000,000.00元,权益登记日为2008年4月10日。根据公告说明,此次收益分配属于对2007年度收益的分配。

原汉鼎证券投资基金于2008年11月11日公告每10份基金单位派发现金红利0.20元,共计派发现金红利10,000,000.00元,权益登记日为2008年11月13日。

原汉鼎证券投资基金于2008年11月20日转型为富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金,新基金按《基金合同》约定:"若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配"。本基金2008年不再进行收益分配。

§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

2008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(原"汉鼎证券投资基金")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

2008年,富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金(原"汉鼎证券投资基金")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(原"汉鼎证券投资基金")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,原"汉鼎证券投资基金"对基金份额持有人进行了两次利润分配,分配金额共计390,000,000.00元。

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(原"汉鼎证券投资基金")2008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3月27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 转型前基金(原汉鼎证券投资基金)年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:原汉鼎证券投资基金

报告截止日:2008年11月19日

单位:人民币元

资产	本期末 2008年11月19日	上年度末 2007年12月31日
资产:	548,266,081.93	1,364,562,271.86
银行存款	76,908,123.32	11,191,838.79
结算备付金	103,058.22	7,878,601.36
存出保证金	348,780.49	499,410.64
交易性金融资产	466,949,187.11	1,342,331,595.33
其中:股票投资	193,487,852.71	1,058,207,272.63
债券投资	273,461,334.40	284,124,322.70
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收利息	3,767,300.09	2,660,825.74
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
其他资产	189,632.70	—
资产合计	548,266,081.93	1,364,562,271.86
负债和所有者权益	本期末 2008年11月19日	上年度末 2007年12月31日
负债:	1,257,397.94	5,549,604.32
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	—	3,039,400.76
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	412,093.46	1,616,353.72
应付托管费	68,682.24	269,392.29
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	112,164.24	219,834.27
应交税费	42,474.93	42,474.93
应付利息	—	—
应付利润	—	—
其他负债	621,983.07	362,148.35
负债合计	1,257,397.94	5,549,604.32
所有者权益:	547,008,683.99	1,359,012,667.54
实收基金	500,000,000.00	500,000,000.00
未分配利润	47,008,683.99	859,012,667.54
所有者权益合计	547,008,683.99	1,359,012,667.54
负债和所有者权益总计	548,266,081.93	1,364,562,271.86

注:报告截止日2008年11月19日,基金份额净值1.0940元,基金份额总额500,000,000.00份。

7.2 利润表

会计主体:原汉鼎证券投资基金

本报告期:2008年1月1日至2008年11月19日

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年11月19日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
一、收入	-398,386,754.52	755,047,140.09
1. 利息收入	6,971,827.04	8,069,690.74
其中:存款利息收入	867,034.57	898,887.49
债券利息收入	6,104,792.47	7,170,803.25
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益(损失以"-"填列)	152,256,681.14	591,486,002.95
其中:股票投资收益	146,415,968.65	581,358,453.84
债券投资收益	240,530.34	957,435.87
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具收益	2,102,046.31	2,899,524.31
股利收益	3,498,135.84	6,270,588.93
3. 公允价值变动收益(损失以"-"填列)	-557,618,833.42	155,491,446.40
4.其他收入(损失以"-"号填列)	3,570.72	—
二、费用(以"-"号填列)	-23,617,229.03	-35,334,472.87
1. 管理人报酬	-11,932,372.02	-17,343,017.11
2. 托管费	-1,988,728.59	-2,890,502.85
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	-6,126,831.48	-6,716,393.84
5. 利息支出	-2,191,925.42	-7,282,412.49
其中:卖出回购金融资产支出	-2,191,925.42	-7,282,412.49
6. 其他费用	-1,377,371.52	-1,102,146.58
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-422,003,983.55	719,712,667.22

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:原汉鼎证券投资基金

本报告期:2008年1月1日至2008年11月19日

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年11月19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	859,012,667.54	1,359,012,667.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-422,003,983.55	-422,003,983.55
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)	—	-390,000,000.00	-390,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	47,008,683.99	547,008,683.99
项目	上年度可比期间 2007年1月1日至2007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	388,550,000.89	888,550,000.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	719,712,667.22	719,712,667.22
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)	—	-249,250,000.57	-249,250,000.57
五、期末所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	859,012,667.54	1,359,012,667.54

7.4 会计报表附注

7.4.1 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

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告不一致。

根据中国证券监督管理委员会证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(以下简称"指导意见")的要求,本基金自2008年9月16日起,对特定投资品种变更了估值方法,具体如下:

(1) 对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值进行估值;

(2) 当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值进行估值;

本基金采用中国证券业协会基金估值工作小组推荐的"指数收益法"进行估值。另外,根据《指导意见》的要求,本基金的管理人对管理的不同基金持有的同一投资品种采用一致的估值政策、程序及相关的方法。对于该会计估计变更,本基金采用未来适用法进行核算。此项会计估计变更于2008年度均系因股票长期停牌而引起,对本基金2008年9月16日的净利润和资产净值无影响,对2008年度净利润及2008年末资产净值无影响。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期未发生重大会计差错,无需更正。

7.4.2 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、基金发起人
中国工商银行股份有限公司(简称"中国工商银行")	基金托管人
海通证券股份有限公司(简称"海通证券")	基金管理人的股东
申银万国证券股份有限公司(简称"申银万国证券")	基金管理人的股东、基金发起人
山东省国际信托有限公司(原名:山东省国际信托投资有限公司)	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

7.4.2.1 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

本基金自2008年1月1日至2008年11月19日止期间存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

7.4.2.2 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
中国工商银行股份有限公司(简称"中国工商银行")	基金托管人
海通证券股份有限公司(简称"海通证券")	基金管理人的股东
申银万国证券股份有限公司(简称"申银万国证券")	基金管理人的股东、基金发起人

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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年11月19日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007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	380,127,263.69	20.42%	409,007,631.43	17.89%
申银万国证券	446,749,901.86	24.00%	427,629,699.50	18.70%

7.4.3.1.2 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年11月19日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	6,270,447.06	86.37%	—	—
申银万国证券	—	—	—	—

7.4.3.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年11月19日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	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
海通证券	99,464,112.42	25.13%	80,228,005.36	27.32%
申银万国证券	63,733,424.69	16.10%	16,126,244.99	5.49%

7.4.3.1.4 回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年11月19日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
海通证券	906,500,000.00	43.50%	1,145,500,000.00	31.67%
申银万国证券	249,800,000.00	11.99%	284,000,000.00	7.85%

7.4.3.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年11月19日			
	当期佣金	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	323,107.63	20.76%	27,957.94	24.93%
申银万国证券	367,500.69	23.61%	31,442.26	28.03%
	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日			
关联方名称	当期佣金	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	328,870.06	18.10%	49,377.86	22.68%
申银万国证券	333,738.89	18.37%	58,317.07	26.79%

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。7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年11月19日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的管理费	11,932,