裕泽证券投资基金

2009年第三季度报告

2009年 9 月 30 日

基金管理人:博时基金管理有限公司 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

基金管理人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 27 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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时裕泽封闭
交易代码	184705
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2000年 3 月 27 日
报告期末基金份额总额	500,000,000 份
投资目标	本基金属于科技基金,主要投资于具有较高科技含量的上市公司。所追求的投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下,谋求基金资本增值和投资收益的最大化。
投资策略	本基金的投资组合应本着收益性、安全性、流动性的原则。依据科技成果和创新能力给上市公司带来的预期收益和发展潜力,通过投资于科技含量较高的上市公司,实现基金长期的股票投资收益。通过综合国内国际经济环境、行业、公司和证券市场的相关因素,确定各类金融工具的投资组合比例,达到分散和降低投资风险,确保基金资产安全,谋求基金收益长期稳定的目的。
业绩比较基准	无
风险收益特征	本基金是一只偏股型的证券投资基金,属于中等风险品种。
基金管理人	博时基金管理有限公司
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(2009 年 7 月 1 日 –2009 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	34,505,388.08
2. 本期利润	–20,870,804.20
3. 加权平均基金份额本期利润	–0.0417
4. 期末基金资产净值	567,907,569.90
5. 期末基金份额净值	1.1358

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。

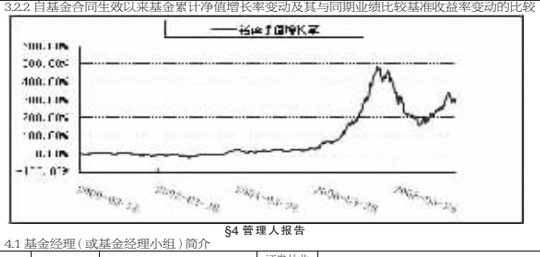
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	–3.55%	2.97%	–	–	–	–

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§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		
陈亮	基金经理/数量组投资总监	2007–1–22	–	10.5 年	1998年起先后在中信证券金融产品开发小组、北京欧方量子软件技术公司工作。2001 年加入博时公司,历任金融工程师、基金经理助理、基金经理、数量组投资总监兼任基金经理。现任数量组投资总监、博时裕泽基金经理、博时特许价值基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《裕泽证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

截至 2009 年 9 月 30 日,本基金份额净值为 1.1358 元,份额累计净值为 3.7058 元。报告期内,本基金份额净值增长率为 –3.55%,同期上证指数上涨 –6.08%。

管理回顾

裕泽基金在 3 季度依然保持了比较进取的资产配置,仓位继续保持较高位置。根据市场的波动情况进行了一定程度的微调。行业选择上,本基金适度增加了一些消费和医药的配置。

投资展望

从中国经济的走向来看,目前经济依然在复苏的轨道上,经济增长上行的动力明显。

固定资产中房地产投资正在强劲恢复之中,在上半年大幅度去库存之后,房价涨幅较大,但是供应的增加才是市场解决之道,随着房地产投资的不断增加,未来一年可供销街面积会逐步增加。

汽车的销售数据也保持较高位置,相关产业也会保持较高的景气度。

通胀目前的大幅度向上的可能性不大,但是从长期来看,通胀的风险在增加。尤其发达经济体的通胀压力会比较大。中国食品价格由于农业投入的不断增加上行压力比预期要小。

总体来看,股票市场将继续保持目前的水平进行震荡,重心将逐步上移,反应业绩恢复的良好预期。

§5 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	365,958,992.09	64.16
	其中:股票	365,958,992.09	64.16
2	固定收益投资	121,761,707.30	21.35
	其中:债券	121,761,707.30	21.35
	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	80,231,699.74	14.07
6	其他资产	2,436,692.52	0.43
7	合计	570,389,091.65	100.00

5.2 报告期末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	18,632,820.00	3.28
C	制造业	212,703,300.34	37.45
C0	食品、饮料	30,216,165.98	5.32
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	8,406,087.24	1.48
C4	石油、化学、塑胶、塑料	45,068,259.81	7.94
C5	电子	–	–
C6	金属、非金属	44,654,652.44	7.86
C7	机械、设备、仪表	75,811,171.50	13.35
C8	医药、生物制品	8,546,963.37	1.50
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,810,600.00	0.32
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	4,629,425.88	0.82
G	信息技术业	10,274,238.00	1.81
H	批发和零售贸易	13,521,750.00	2.38
I	金融、保险业	76,430,914.53	13.46
J	房地产业	27,955,943.34	4.92
K	社会服务业	–	–
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	365,958,992.09	64.44

5.3 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	601939	建设银行	5,020,000	28,011,600.00	4.93
2	000651	格力电器	810,000	17,658,000.00	3.11
3	002001	新 和 成	400,000	17,552,000.00	3.09
4	600031	三一重工	499,950	16,588,341.00	2.92
5	600519	贵州茅台	99,968	16,480,724.48	2.90
6	000528	柳 工	999,930	16,418,850.60	2.89
7	600362	江西铜业	450,000	15,376,500.00	2.71
8	000898	鞍钢股份	1,352,376	15,335,943.84	2.70
9	000927	一汽夏利	2,070,000	14,034,600.00	2.47
10	002024	苏宁电器	825,000	13,521,750.00	2.38

5.4 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	50,302,707.30	8.86
2	央行票据	71,459,000.00	12.58
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	–	–
7	其他	–	–
8	合计	121,761,707.30	21.44

5.5 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	0801038	08央行票据38	500,000	51,805,000.00	9.12
2	010004	20国债(4)	444,470	45,153,707.30	7.95
3	0901044	09央行票据44	200,000	19,654,000.00	3.46
4	010112	21国债(2)	50,000	5,149,000.00	0.91

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 报告期内基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	701,518.91
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,735,173.61
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	2,436,692.52

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位:份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	2,500,000
报告期期间买入总份额	–
报告期期间卖出总份额	–
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	2,500,000
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	0.50

§7 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2009 年 9 月 30 日,博时基金公司共管理十三只开放式基金和三只封闭式基金,并且受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金,以及多个企业年金账户,资产管理总规模逾 1900 亿元。博时基金公司是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一,养老金资产管理规模在同业中名列前茅,累计分红超过人民币 435 亿元。

1、业绩表现

1)今年以来截至 2009 年 9 月 25 日,根据中国银河证券基金研究中心业绩统计报告,博时管理的基金中,博时新兴成长、博时特许价值、博时精选、博时平衡配置在同类型基金中排名均位列前 1/3;

博时精选基金在普通股票型基金中位列第 2 名;博时平衡配置基金在股债平衡型基金中位列第 2 名;博时裕阳在封闭式基金中位列第 2 名。

2)今年以来截至 2009 年 9 月 25 日,在中国银河证券基金研究中心的星级评价中,博时主题行业、博时平衡配置基金被评为过去三年五星级基金。博时裕隆、博时裕阳均被评为过去三年五星级基金。

2、客户服务

博时公司客户服务中心以为客户提供高品质服务为目标,不断提高客户服务能力,持续为客户提供热情、专业、高效的服务。

1)为满足不同客户的差异性需求,2009 年 3 季度博时公司对净值短信功能进行了全面升级,根据客户的需求,可以为客户发送持有基金的净值、指定基金的净值和博时旗下全部基金的净值三种形式的净值短信。

2)2009 年 3 季度中开通了民生银行借记卡的网上直销交易功能。截至 2009 年 3 季度末,博时网上直销已经开通 10 种网上交易渠道,方便投资者办理基金交易。

3)2009 年 3 季度,博时基金网上交易平台——“博时快 e 通”已经通过中国信息安全产品测评中心的安全测评与认证。“博时快 e 通”还推出了“网上交易安全中心”,免费为客户提供在线安全检测、漏洞修复、木马查杀等功能,清除客户计算机中的安全隐患。

4)作为博时基金旗下高端品牌系列活动之一,“信心·中国·价值”高端论坛三季度在厦门、武汉、重庆、兰州、洛阳、南京等地共举办九场活动。演讲嘉宾就宏观经济、资本市场等话题发表演讲,并结合当前市场动态与到场客户进行了深入浅出的交流,受到投资者热烈欢迎。除现场交流外,博时基金还在公司网站开辟专题页面,让更多未到现场的投资者了解“信心·中国·价值”高端论坛,分享专家的见解。

3、公司荣誉

1)2009 年 9 月 22 日,博时在由《理财周报》主办的“2009 中国最受尊敬基金公司”评选中,荣获此次评选的最高奖项——“2009 中国基金行业卓越贡献大奖”,同时,还获得“2009 最佳公司治理基金公司”以及“2009 最佳品牌塑造基金公司”两项大奖。

2)2009 年 9 月 25 日,公司被《证券时报》授予“年度最佳基金网站”。

4、其他大事件

1)博时一直以来都将企业年金业务作为重要战略业务对待,截至 2009 年 9 月 30 日,博时已中标或签约客户超过 220 家,委托规模预计超过 160 亿元人民币,位居同业前列。

2)博时策略灵活配置基金于 2009 年 7 月 15 日至 8 月 7 日发行,发行期募集规模超过 88 亿元。

3)博时于 2009 年 9 月 24 日和 25 日分别在上海和北京举行“2009 ETF 与量化投资论坛”,有超过 450 名来自各大银行、券商及客户的代表参加了此次论坛,包括著名国际量化投资专家、博时基金首席研究顾问李勉群教授在内的博时投研团队在会上发表了主题演讲,得到了与会嘉宾的广泛好评。

4)今年 8 月份,博时基金净增基金账户近 10 万户。截至 2009 年 8 月末,博时所有开放式基金账户总数逾 1100 万户。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1 中国证监会批准裕泽证券投资基金设立的文件

8.1.2《裕泽证券投资基金基金合同》

8.1.3《裕泽证券投资基金托管协议》

8.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

8.1.5 裕泽证券投资基金各年度审计报告正本

8.1.6 报告期内裕泽证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

8.2 存放地点:

基金管理人、基金托管人处

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

客户服务中心电话:95105568(免长途话费)

富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金

2009年第三季度报告

2009年 9 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

基金简称	富国天鼎中证红利指数增强
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%×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	(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。

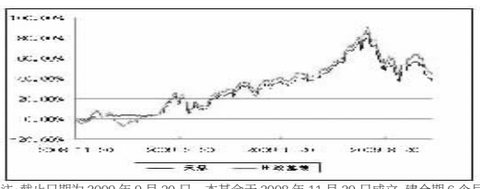
3.2 富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金净值表现

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遵规守信情况说明

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

@

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额。

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中期赎回冲击,为应对中期赎回,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

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

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	098062	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	–
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

富国天博创新主题股票型证券投资基金

2009年第三季度报告

2009年 9 月 30 日

基金管理人:富国基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司 (简称中国建设银行) 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。

基金托管人中国建设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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 7 月 1 日起至 2009 年 9 月 30 日止。