富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)

(二0一0年第二号)

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”)由中国证券监督委员会于2008年11月11日证监许可[2008]1261号文核准。本基金的基金合同于2008年11月20日正式生效。

【重要提示】

投资有风险,投资人拟申购本基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金的基金合同。

本招募说明书所载内容截止至2010年11月20日,基金投资组合报告截止至2010年9月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

本基金基金管理人为富国基金管理有限公司,基本信息如下:

名称:富国基金管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

办公地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

法定代表人:陈敏

总经理:窦玉明

成立日期:1999年4月13日

电话:(021)68597788

传真:(021)68597799

联系人:李长伟

注册资本:1.8亿元人民币

股权结构(截止于2010年11月20日):

股东名称	出资比例
海通证券股份有限公司	27.775%
申银万国证券股份有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托有限公司	16.675%

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作的风险控制和管理工作,确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则,防范和化解运作风险,合规与道德风险。

公司目前下设十七个部门和二个分公司,分别是:权益投资部、固定收益部、另类投资部、研究部、集中交易部、专户投资部、机构业务部、零售业务部、营销策划与产品部、客服与电子商务部、战略发展部、监察稽核部、计划财务部、人力资源部、行政管理部、信息技术部、运营部、北京分公司和深圳分公司。权益投资部:负责权益类基金产品的投资管理;固定收益部:负责固定收益类产品的研究与投资管理;另类投资部:负责FOF、PE、定量类产品等的研究与投资管理;研究部:负责行业研究、上市公司研究和证券评级;集中交易部:负责投资交易和风险控制;专户投资部:在固定收益部、权益投资部和另类投资部内设立的虚拟部门,独立负责年金等专户产品的投资管理;机构业务部:负责年金、账户、社保以及共同基金的机构客户营销工作;零售业务部:管理华北营销中心、华南营销中心、华东营销中心、华中营销中心、北方营销中心和西部营销中心,负责共同基金的零售业务;营销策划与产品部:负责产品开发、营销策划和品牌建设等;客服与电子商务部:负责电子商务与客户服务;战略发展部:负责公司战略的研究、规划与落实;监察稽核部:负责监察、风控、法务和信息披露;信息技术部:负责软件开发与系统维护等;运营部:负责基金会计与清算;计划财务部:负责公司财务计划与管理;人力资源部:负责人力资源规划与管理;行政管理部:负责文秘、行政后勤等。

截止到2010年11月20日,公司有员工177人,其中60%以上具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

陈敏女士,董事长。生于1954年,中共党员,工商管理硕士,经济师。历任上海市信托投资公司副处长、处长;上海市外经贸委处长;上海万国证券公司党委书记;申银万国证券股份有限公司副总裁、党委委员。2004年开始担任富国基金管理有限公司董事长。

窦玉明先生,董事,总经理。生于1969年,硕士。历任北京中信国际合作公司交易员;深圳君安证券公司投资经理;大成基金管理有限公司基金经理助理;嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理。2008年开始担任富国基金管理有限公司总经理。

麦陈婉芬女士(Constance Mak),副董事长。文学及商学学士,加拿大注册会计师。1977年加入加拿大毕马威会计事务所的前身Thorne Riddell公司,并于1989年成为加拿大毕马威的合伙人之一。现任BMO投资有限公司亚洲业务总经理,兼任加中贸易理事会董事。

李明山先生,董事。生于1952年,中共党员,硕士,高级经济师。历任申银万国证券股份有限公司副总经理;上海证券交易所副总经理。现任海通证券股份有限公司总经理。

方荣义先生,董事。生于1966年,中共党员,博士,高级会计师。历任北京用友电子财务技术有限公司研究所信息中心副主任;厦门大学工商管理教育中心副教授;中国人民银行深圳经济特区分行深圳市中心支行会计处副处长;中国人民银行深圳市中心支行非银行金融机构处处长;中国银行业监督管理委员会深圳监管局财务会计处处长、国有银行监管处处长。现任申银万国证券股份有限公司财务总监。

Edgar Normund Leggdins先生,董事。生于1958年,学士,加拿大注册会计师。1980年至1984年在Coopers & Lybrand担任审计工作;1984年加入加拿大BMO银行金融集团蒙特利尔银行。现任BMO投资有限公司首席执行官、BMO金融集团高级副总裁及董事总经理。

葛航先生,董事。生于1966年,大学本科,经济师。历任山东省国际信托有限公司资金信托部业务经理;山东省国际信托有限公司租赁信托部副经理、经理。现任山东省国际信托有限公司自营业务部经理。

戴国强先生,独立董事。生于1952年,博士学位。历任上海财经大学助教、讲师、副教授、教授,金融学院副院长、常务副院长、院长;上海财经大学教授、博士生导师,金融学院党委书记,教授委员会主任。现任上海财经大学MBA学院院长、党委书记。

Wai P.Lam先生,独立董事。生于1936年,会计学博士。1962年至1966年在PriceWaterHouseCoopers会计师事务所担任助理会计和高级会计;1966年至1969年在加拿大圣玛利亚大学担任教师;1973年至2002年在加拿大Windsor大学担任教授;现任加拿大Windsor大学名誉教授。

汤期庆先生,独立董事,生于1955年,经济学硕士。历任上海针织品批发公司办事员、副科长;上海市第一商业局副科长、副处长、处长;上海交电家电商业集团公司总经理;上海市第一商业局局长助理、副局长;上海商务中心总经理;长江经济联合发展集团总裁、副董事长、党组书记。现任上海水产集团总公司董事长、党委书记。

李宏明先生,独立董事。生于1969年,中共党员,博士。历任吉林大学法学院教师。现任上海市锦天城律师事务所律师、高级合伙人。

2、监事会成员

金同水先生,监事长。生于1965年,大学专科。历任山东省国际信托有限公司科员、项目经理、业务经理;鲁信投资有限公司财务经理;山东省国际信托有限公司高级业务经理。现任山东省国际信托有限公司风险管理部经理。

沈黄先生,监事。生于1962年,法学学士。历任上海市中级人民法院助理审判员、审判员、审判组长;上海市第二中级人民法院办公室综合科科长。现任申银万国证券股份有限公司合规稽核总部高级法律顾问。

夏瑾璐女士,监事。生于1971年,工商管理硕士。历任上海大学外语系教师;荷兰银行上海分行结构融资部经理;蒙特利尔银行金融机构部总裁助理;荷兰银行上海分行助理副总裁。现任蒙特利尔银行上海代表处首席代表。

仇夏萍女士,监事。生于1960年,中共党员,研究生。历任中国工商银行上海分行杨浦支行所主任;华夏证券有限公司上海分公司财务主管。现任海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。

胡志荣女士,监事。生于1973年,中共党员,硕士。历任四川成都邮电通信设备厂财务处会计;厦门金达通信电子有限公司财务部财务主管。现任富国基金管理有限公司财务经理。

丁飚先生,监事。生于1976年,民革党员,硕士。历任中国建设银行上海市分行信贷员、富国基金管理有限公司营销策划经理、客户服务部经理。现任富国基金管理有限公司客服与电子商务部高级客户服务经理。

3、督察长

李长伟先生,督察长。生于1964年,中共党员,经济学硕士,工商管理硕士,讲师。历任河南省政府发展研究中心干部;中央党校经济学部讲师;申银万国证券股份有限公司海口营业部总经理、北京营业部总部经理兼北京营业部总经理、富国基金管理有限公司副总经理。2008年开始担任富国基金管理有限公司督察长。

4、经营管理层人员

窦玉明先生,总经理(简历请参见上述关于董事的介绍)。

林志松先生,副总经理。生于1969年,中共党员,大学本科,工商管理硕士。曾在漳州商检局办公室、晋江商检局检验科、厦门证券公司投资发展部工作。曾任富国基金管理有限公司监察稽核部稽察员、高级稽察员、部门副经理、经理、督察长。2008年开始担任富国基金管理有限公司副总经理。

陈文先生,副总经理。生于1972年,中共党员,硕士,1996年起开始从事证券行业工作。曾任君安证券研究所研究员。2000年10月加入富国基金管理有限公司,历任研究策划部研究员、研究策划部经理、总经理助理,2005年4月起任富国天益价值证券投资基金基金经理至今,2009年1月起兼任权益投资部总经理。2008年开始担任富国基金管理有限公司副总经理。

孟朝霞女士,副总经理。生于1972年,硕士研究生,12年金融领域从业经历。曾任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理,泰康养老保险股份有限公司副总经理。2009年开始担任富国基金管理有限公司副总经理。

5、本基金基金经理

(1)现任基金经理:常松先生,生于1973年,管理学博士,自2001年加入富国基金管理有限公司。曾先后担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。2008年11月至今任富国天鼎基金经理,2009年12月起兼任富国沪深300增强证券投资基金基金经理。

(2)历任基金经理:本基金第一任基金经理为宋小龙先生,任职时间为2008年11月至2010年1月。

6、投资决策委员会

投资决策委员会成员构成如下:公司总经理窦玉明先生,公司主管投研副总经理陈文先生,研究部总经理朱少醒先生,固定收益部总经理饶刚先生等人员。

列席人员包括:督察长、集中交易部总经理以及投委会主席邀请的其他人员。

本基金采取集体投资决策制度。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:姜建清

注册资本:人民币334,018,850,026元

联系电话:010-66105799

联系人:蒋松云

(二)主要人员情况

截至2010年9月末,中国工商银行资产托管部共有员工121人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年开展托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,严格履行资产托管人的责任和义务,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、先进的业务营运系统和专业的托管服务团队,为广大投资者、众多资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。建立了包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、收支账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、银行理财产品等门类齐全的托管产品体系。截至2010年9月,中国工商银行托管证券投资基金177只,其中封闭式8只,开放式169只。2010年,中国工商银行凭借在2009年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力,先后被英国《环球托管人》、香港《财资》和美国《环球金融》评选为“2009年度中国最佳托管银行”,本届《财资》评选首次设立了在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项,中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获“年度最佳托管银行家”称号,是仅有的两位获奖人之一。自2004年以来,中国工商银行资产托管服务已经获得23项国内外大奖。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.直销机构:富国基金管理有限公司

住所:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

办公地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

法定代表人:陈敏

总经理:窦玉明

成立日期:1999年4月13日

电话:(021)68597070

传真:(021)68597979

联系人:林燕珏

客户服务统一咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)

公司网站:www.fullgoal.com.cn

2.代销机构:

(1)中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

联系电话:010-66107900

传真:010-66107914

客户服务统一咨询电话:95588

公司网址:www.icbc.com.cn

(2)中国建设银行股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:郭树清

电话:010-66275654

联系人:王琳

客户服务电话:95533

公司网站:www.ccb.com

(3)中国邮政储蓄银行

住所:北京市西城区宣武门西大街131号

办公地址:北京市西城区宣武门西大街131号

法定代表人:陶礼明

联系人:陈春林

传真:010-66419824

客户服务热线:11185

公司网站:www.psbc.com

(4)交通银行股份有限公司

注册地址:上海市仙霞路18号

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:胡怀邦

联系电话:021-58781234

传真:021-58408483

联系人:曹榕

客户服务统一咨询电话:95559

公司网站:www.bankcomm.com

(5)招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:秦晓

电话:0755-83198888

传真:0755-83195047

联系人:王楠

客户服务电话:95555

公司网站:www.cmbchina.com

(6)上海银行股份有限公司

注册地址:上海市银城中路168号上海银行大厦35层

办公地址:上海市银城中路168号上海银行大厦35层

法定代表人:宁黎明

电话:021-63370888

传真:021-63370777

联系人:张萍

咨询电话:021-962888

公司网站:www.bankofshanghai.com

(7)申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

联系电话:021-54040596

传真:021-64738844

联系人:王玲微

客户服务电话:021-962505

公司网站:www.sw2000.com.cn

(8)中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:顾伟国

电话:010-66568888

传真:010-66568536

联系人:田薇

客户电话:010-68016655

公司网站:www.chinastock.com.cn

(9)华泰证券股份有限公司

注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

联系电话:025-84457777

传真:025-84579763

联系人:张小波

客户咨询电话:025-84579897

公司网站:www.htsc.com.cn

(10)广发证券股份有限公司

注册地址:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址:广东广州天河北路大都会广场36、38、41和42楼

法定代表人:王志伟

联系人:肖申梅

联系电话:020-87555888

传真:020-87555303

客服电话:95575

公司网站:www.gf.com.cn

(11)中国建银投资证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48层-50层

办公地址:深圳市福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48层-50层

法定代表人:杨小阳

电话:0755-82026521

传真:0755-82026539

联系人:刘权

客服电话:4006008008

公司网址:www.cjis.cn

(12)按信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

办公地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

法定代表人:牛冠兴

电话:0755-82825555

传真:0755-82825560

联系人:李瑾

客服电话:020-96210、400-8001-001

公司网址:www.essence.com.cn

(13)招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层

法定代表人:宫少林

联系电话:0755-82943666

传真:0755-82943636

联系人:黄健

客服热线:400-8888-111、0755-26951111

公司网站:www.newone.com.cn

(14)中信建投证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:张佑君

联系电话:010-65183888

联系人:魏明

开放式基金咨询电话:400-8888-108(免长途费);

公司网站:www.csc108.com

(15)太山西证券股份有限公司

注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人:侯魏

联系电话:0351-8686659

联系人:郭熠

客户服务电话:400-666-1618

公司网站:www.i618.com.cn

(16)东海证券有限责任公司

注册地址:常州延陵西路59号常信大厦18、19楼

办公地址:上海东方路989号中达广场17楼

法定代表人:朱科敏

联系电话:021-50588876

传真:021-50586660-8880

联系人:邵一明

客服热线:400-8888-588(全国)、021-32024658(上海)、0519-88166222(常州)、0379-64902266(洛阳)

公司网站:www.longone.com.cn

(17)光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

办公地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系电话:021-50818887-281

联系人:刘晟

客服热线:400-8888-788

公司网站:www.ebscn.com

(18)国元证券有限责任公司

注册地址:合肥市寿春路179号

办公地址:合肥市寿春路179号国元证券大厦

法定代表人:凤良志

电话:0551-2624400

传真:0051-2645709

联系人:程翔

客服热线:4008-888-777

公司:www.gyzq.com.cn

(19)宁波银行股份有限公司

注册地址:宁波市江东区中山东路294号

办公地址:宁波市江东区中山东路294号

法定代表人:陆华裕

电话:0574-87050397

传真:0574-87050024

联系人:钱庚旺

客服电话:96528

公司网址:www.nbcb.com.cn

(20)海通证券股份有限公司

注册地址:上海市淮海中路98号

办公地址:上海市广东路689号

法定代表人:王开国

联系电话:021-23219000

联系人:金芸

客服热线:95553、400-8888-001

公司网站:www.htsec.com

(21)东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:潘鑫军

联系电话:021-63325888

联系人:吴宇

客服电话:95503

公司网站:www.dfzq.com.cn

(22)国联证券股份有限公司

注册地址:无锡市县前东街168号

办公地址:无锡市县前东街168号国联大厦6楼、7楼

法定代表人:范炎

联系人:袁丽萍

客服电话:0510-82588168、400-8885-288

开放式基金业务传真:0510-82830162

公司网站:www.glsc.com.cn

(23)上海证券有限责任公司

注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号

办公地址:上海市黄浦区西藏中路336号

法定代表人:邹忠民

电话:021-53519888

传真:021-53519888

联系人:张瑾

客服热线:021-962518

公司网站:www.962518.com

(24)瑞银证券有限责任公司

注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人:刘弘

电话:010-59226788

传真:010-59226799

联系人:谢亚凡

客服电话:4008878827

公司网站:www.ubssecurities.com

(25)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦

法定代表人:祝幼一

联系电话:021-62580818

传真:021-38670666

联系人:芮敏祺

客服热线:400-8888-666

公司网站:www.gtja.com

(26)湘财证券有限责任公司

注册地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人:林俊波

联系电话:021-68634518

传真:021-68865680

联系人:钟康莉

客服热线:400-8881-551、021-38784525

(27)平安证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人:杨宇翔

传真:0755-82400862

联系人:周璐

客服电话:4008816168

公司网站:www.pingan.com

(28)平安银行股份有限公司

住所:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

办公地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人:孙立哲

电话:0755-25859591

联系人:霍兆龙

客户服务电话:40066-99999

公司网站:www.18ebank.com

(29)华西证券有限责任公司

注册地址:四川省成都市陕西街239号

办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼(深圳总部)

法定代表人:胡关金

电话:0755-83025913

传真:0755-83025991

联系人:张友德

客服热线:400-8888-818

公司网站:www.hx168.com.cn

(30)齐鲁证券有限公司

注册地址:山东省济南市经十路128号

办公地址:山东省济南市经十路128号

法定代表人:李祥

电话:0531-81283938

传真:0531-82024197

联系人:付咏梅

客户服务热线:0531-82024197

公司网站:www.qlzq.com.cn

(31)长江证券股份有限公司

注册地址:武汉新华下路特8号长江证券大厦

办公地址:武汉新华下路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

电话:027-85799999

传真:027-85481900

联系人:李良

咨询电话:95579或4008-888-999

公司网站:www.95579.com

(32)恒泰证券股份有限公司

注册地址:内蒙古呼和浩特市新城新华东街111号

办公地址:内蒙古呼和浩特市新城新华东街111号

法定代表人:牛犇

开放式基金咨询电话:0471-4961259、02168405273

开放式基金业务传真:021-64433260

联系人:张同亮

联系电话:021-64224632

公司网站:www.cnht.com.cn

(33)东北证券股份有限公司

注册地址:长春市自由大路1138号

办公地址:长春市自由大路1138号

法定代表人:矫正中

联系人:潘锦

电话:0431-85096709

客服电话:0431-96688

公司网址:www.nesc.cn

(34)中国农业银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西三环北路100号金玉大厦

法定代表人:项俊波

传真:010-85109219

客户服务电话:95599

公司网站:www.abchina.com

(35)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址:上海市北京东路689号

邮政编码:200120

法定代表人:寇晓辉

联系人:徐伟

联系电话:021-61618888

传真:021-63604199

客服热线:95528

公司网站:www.spdb.com.cn

(36)国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人:何如

联系电话:0755-82130833

传真:0755-82133302

联系人:林建闽

客户服务统一咨询电话:800-810-8868

公司网站:www.guosen.com.cn

(37)北京银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街甲17号北京银行大厦

办公地址:北京市西城区金融大街17号北京银行大厦

法定代表人:闫冰竹

电话:010-66223248

联系人:杨永杰

客户服务电话:010-96169

公司网站:www.bankofbeijing.com.cn

(38)长城证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人:黄耀华

电话:0755-83516094

传真:0755-83516199

联系人:高峰

客户服务热线:0755-33680000(深圳)、400-6666-888(非深圳地区)

公司网站:www.cc168.com.cn

(39)中信万通证券有限责任公司

注册地址:崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层

办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人:张智河

联系电话:0532-85022326

业务传真:0532-85022605

联系人:吴忠超

客服电话:0532-96577

公司网站:www.zwt.com.cn

(40)华泰联合证券有限责任公司

注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人:马昭明

联系电话:0755-82492000

传真:0755-82492962

联系人:盛宗凌

客户服务咨询电话:400-8888-555

公司网站:www.lhzq.com

(41)兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路99号标力大厦

办公地址:上海市浦东陆家嘴东路166号中保大厦22层

法定代表人:兰荣

电话:021-68419393-1035、68419974

联系人:杨盛芳

传真:021-68419867

客服热线:400-8888-123、0591-87580107

公司网站:www.xyzq.com.cn

(42)东莞银行有限责任公司

注册地址:东莞市城区运河东一路193号

办公地址:东莞市城区运河东一路193号

法定代表人:廖玉林

联系人:胡昱

电话:0769-22119061

传真:0769-22117730

服务热线:96228

网址:www.dongguanbank.cn

(43)深圳发展银行股份有限公司

住所地址:深圳深南东路5047号深圳发展银行大厦

办公地址:深圳深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人:肖遂宁

电话:0755-82088888

传真:0755-82080714

联系人:周勤

客户服务热线:95501

网址:www.sdb.com.cn

(44)宏源证券股份有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号

办公地址:北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人:冯戎

联系人:李巍

电话:010-62267799-6318

客服电话:0991-96562

公司网址:www.ehongyuan.com

(45)广发华福证券有限责任公司

注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层

法定代表人:黄金琳

电话:0591-87841160

传真:0591-87841150

公司网址:www.gfhfzq.com.cn

(46)中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:孔丹

联系人:郭伟

电话:010-65557048

传真:010-65541281

客户服务热线:95558

公司网站:www.ecitic.com

(47)英大证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法人代表:赵文安

联系人:王睿

电话:0755-83007069

客服电话:0755-26982993

公司网址:www.ydsc.com.cn

(48)长江海证券有限公司

注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人:孙名扬

联系电话:徐世旺

联系人:0451-82336863

客服电话:400-666-2288

公司网站:www.jrzq.com.cn

(49)信达证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

办公地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

客服电话:400-800-8899

公司网站:www.cindasc.com

(50)华龙证券有限责任公司

住所:甘肃省兰州市静宁路308号

办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号

法定代表人:李晓安

电话:0931-4890100

传真:0931-4890118

联系人:李昕田

客服电话:0931-4890100、4890619、4890618

公司网站:www.hlzqgs.com

(51)天通证券股份有限公司

注册地址:大连市中山区人民路24号

办公地址:大连市中山区人民路24号

法定代表人:于宏民

电话:0411-39673202

传真:0411-39673219

联系人:谢立军

客服电话:4008-169-169

公司网站:www.hlzqgs.com

(52)中银国际证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人:唐新宇

电话:021-68604866-8309

传真:021-58774179

联系人:张静

客服热线:021-68604866

公司网址:www.bocichina.com

(53)国海证券有限责任公司

注册地址:广西南宁市滨湖路46号

办公地址:广西南宁市滨湖路46号

法定代表人:张雅锋

电话:0771-5539262

传真:0771-5539033

联系人:覃清芳

客服热线:4008888100(全国)、96100

公司网址:www.ghzq.com.cn

(54)渤海银行股份有限公司

注册地址:天津市河西区马场道201-205号

办公地址:天津市河西区马场道201-205号

法定代表人:刘宝凤

电话:022-58316666

传真:022-58316259

联系人:王宏

客服电话:4008888811

公司网站:http:/www.cbhb.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构:富国基金管理有限公司

名称:富国基金管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

办公地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

法定代表人:陈敏

总经理:窦玉明

成立日期:1999年4月13日

电话:021-68597788

传真:021-68597799

联系人:雷青松

(三)相关法律意见书的律师事务所(临金募集时)

名称:上海源泰律师事务所

注册地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人:廖海

联系电话:021-51150298

传真:021-51150398

联系人:廖海

经办律师:黎明、吴军敏

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所有限责任公司

注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

办公地址:上海市长乐路989号世纪商贸广场23楼

法定代表人:葛明

联系电话:021-22288888

传真:021-22280000

联系人:徐艳

经办注册会计师:徐艳、蒋燕华

四、基金的名称

富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

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。

1、指数化投资为主:

本基金主要采用完全复制目标指数策略,按照成份股在目标指数中的基准权重来构建股票投资组合,从而有效跟踪目标指数,控制跟踪误差,防止出现相对于目标指数的大幅度偏离。

2、主动性投资为辅:

在指数化投资过程中,由于交易成本的存在,完全复制策略可能很难有效达到拟合目标指数的目的。因此,本基金将主要采用有限度“个股调整策略(主动性投资)对指数化投资进行修正,以求降低由于交易成本导致的对指数跟踪技术的影响,并力争适度超越指数,获取超额收益。

(“有限度”包含两层含义:成份股内被调整股票的数量和投资比例的调整幅度是有限度的;非成份股被选定的数量和投资比例是有限度的。)

(1)在成份股内进行有限度调整。

本基金在充分研究的基础上,将目标指数的成份股分成三类——价值被低估的正超额收益预期的成份股、估值较合理的无超额收益预期的成份股以及价值被高估的负超额收益预期的成份股。在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后,本基金将有限度地增持正超额收益预期成份股的权重以及有限度地减持负超额收益预期成份股的权重。

(2)对非成份股进行有限度调整。

本基金将基于投研团队充分的调研与全面的论证,进行以下三种具体操作:

①给理替代部分流动性缺失的成份股。因基准指数成份股停牌限制、交易量不足等市场流动性因素,使得本基金无法依照目标指数权重购买某成份股。因此,本基金管理人将视当时具体情况,在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上,决定是否买入相关的替代性股票。

②剔除性纳入部分备选成份股。如果预期目标指数的成份股将会发生调整,本基金管理人将视当时具体情况,在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上,决定是否提前纳入部分备选成份股。

③精选部分蕴含价值的非成份股。本基金管理人将采用数量化分析与基本面判断相结合的研究方法,根据当时具体情况,在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上,决定是否买入部分蕴含投资价值、具有增长潜力的非成份股。

此外,本基金还将及时把握一级市场上新股申购与增发的盈利机会,并适度进行成份股与相应可转换债券之间的套利操作,以求提高资金运用效率。同时,本基金也可能审慎使用金融衍生产品,以对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险。

3、对目标指数的跟踪调整:

①定期调整

本基金所构建的投资组合将主要根据所跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。中证指数委员会原则上每半年审核一次中证红利指数成份股。本基金将按照中证红利指数对成份股及其权重的调整方案,在考虑跟踪误差风险的基础上,对股票投资组合进行相应调整。

②不定期调整

根据指数编制规则,当中证红利指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整。

调整期间原则上定为:中证指数公司调整决定公布日至该股票除权日之前。

4、跟踪误差的控制和再平衡调整:

本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中,跟踪误差为核心监控指标,跟踪偏离度为辅助监控指标,以求控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。

核心监控指标:

,其中:

r_i=第i日基金净值收益率-第i日基金业绩比较基准收益率;

,n为计算区间,本基金选定30个交易日。

辅助监控指标:

跟踪偏离度=前n日基金净值累计收益率-前n日基金业绩比较基准累计收益率。

上述跟踪误差指标的最大容忍值设定为0.5%(相应折算的年跟踪误差约为7.75%)。本基金每周计算上述跟踪误差。如果该指标接近或者超过0.5%,并且跟踪偏离度小于0,则本基金管理人将通过归因分析模型找出跟踪误差的来源,并在适当的时机进行再平衡调整操作,使得跟踪误差回复到最大容忍值以下。

当本基金运作发展到一定阶段后,本基金可能会将测算基础转为代表相同风险度的周或月跟踪偏离度,具体变化将另行公告。

九、基金的业绩比较基准

基金业绩比较基准=90%×中证红利指数收益率+10%×一年期银行储蓄存款利率(税后)。

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。

十、基金的投资组合报告

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	908,160,624.71	90.36
	其中:股票	908,160,624.71	90.36
2	固定收益投资	300,427.40	0.03
	其中:债券	300,427.40	0.03
	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	90,413,184.81	9.00
6	其他资产	6,138,796.75	0.61
7	合计	1,005,013,033.67	100.00

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	118,256.76	0.01
B	采掘业	16,927,331.15	1.69
C	制造业	61,455,529.66	6.15
C0	食品、饮料	249,237.34	0.02
C1	纺织、服装、皮毛	117,280.64	0.01