

富国中证红利指数增强型证券投资基金

二〇二〇年第4季度报告

2020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

报告送出日期：2021年01月22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2021年1月20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2020年10月1日起至2020年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	富国中证红利指数增强		
基金主代码	100032		
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）	3,614,426,287.95		
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，主要采用完全复制目标指数策略，即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。在完全复制目标指数的基础上本基金有限度地调整个股，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。本基金的存托凭证投资策略、对目标指数的跟踪调整、跟踪误差的控制和再平衡调整详见法律文件。		
业绩比较基准	$90\% \times \text{中证红利指数收益率} + 10\% \times \text{一年期银行储蓄存款利率（税后）}$		
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		
下属分级基金的基金简称	富国中证红利指数增强 A	富国中证红利指数增强 C	
下属分级基金的交易代码	前端	后端	008682
	100032	100033	
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	3,586,681,110.80		27,745,177.15

§ 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	富国中证红利指数增强 A 报告期（2020 年 10 月 01 日-2020 年 12 月 31 日）	富国中证红利指数增强 C 报告期（2020 年 10 月 01 日-2020 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	229,595,408.45	2,385,822.77
2. 本期利润	159,507,552.90	3,973,129.24
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0440	0.0774
4. 期末基金资产净值	4,036,892,168.78	31,146,430.30
5. 期末基金份额净值	1.126	1.123

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 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

（1）富国中证红利指数增强 A

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	4.07%	0.90%	4.15%	0.85%	-0.08%	0.05%
过去六个月	13.74%	1.19%	11.25%	1.12%	2.49%	0.07%
过去一年	7.55%	1.27%	3.50%	1.20%	4.05%	0.07%
过去三年	8.60%	1.13%	-2.01%	1.10%	10.61%	0.03%
过去五年	33.10%	1.09%	6.13%	1.05%	26.97%	0.04%
自基金合同生效起至今	250.65%	1.38%	137.75%	1.38%	112.90%	0.00%

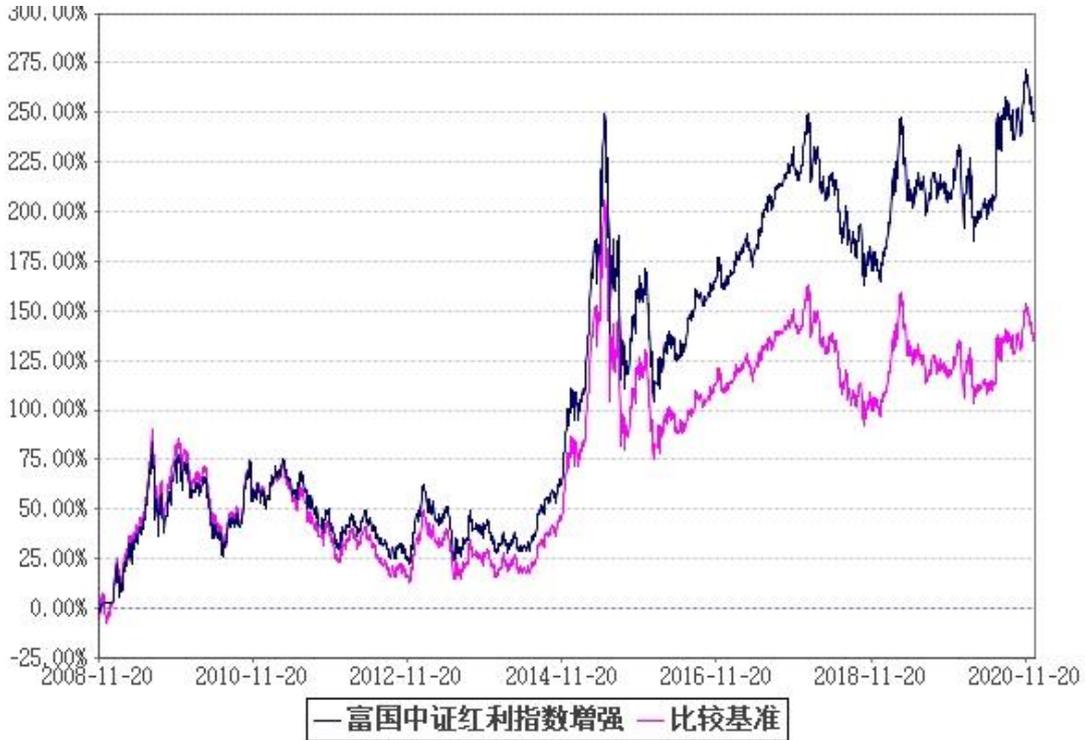
（2）富国中证红利指数增强 C

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	3.98%	0.89%	4.15%	0.85%	-0.17%	0.04%
过去六个月	13.43%	1.19%	11.25%	1.12%	2.18%	0.07%
自基金分级生效日起至 今	10.10%	1.10%	5.30%	1.05%	4.80%	0.05%

3.2.2 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

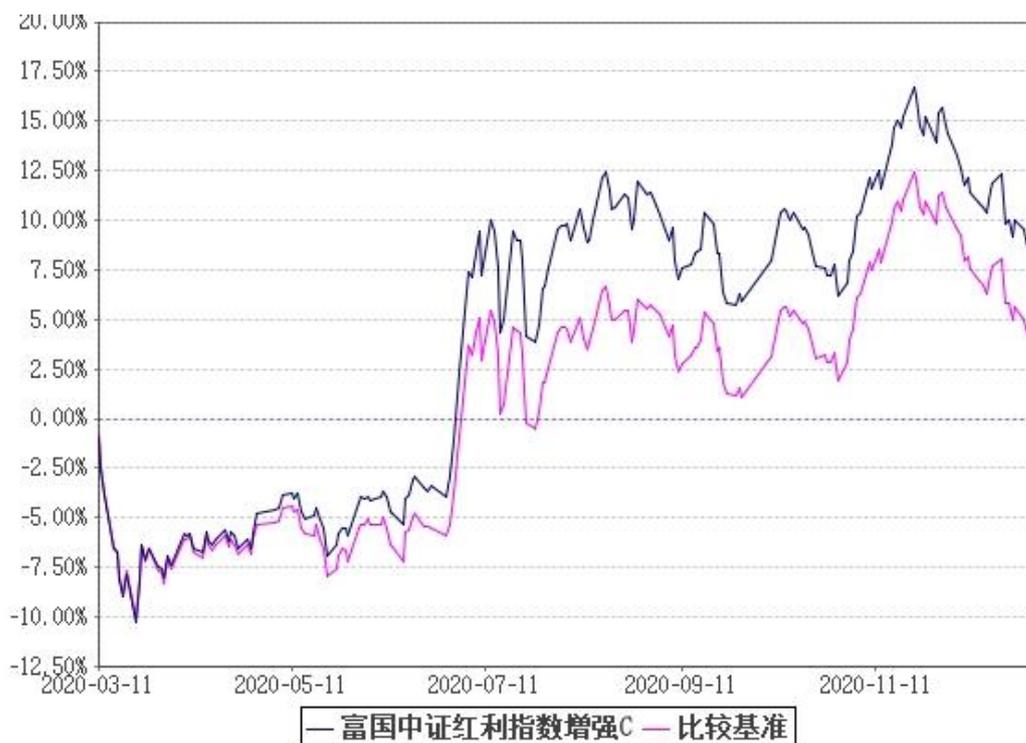
收益率变动的比较

(1) 自基金自基金转型以来以来富国中证红利指数增强 A 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



注：1、截止日期为2020年12月31日。2、本基金于2008年11月20日由原汉鼎证券投资基金转型而成，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。

(2) 自基金自基金转型以来以来富国中证红利指数增强 C 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



注：1、截止日期为2020年12月31日。

2、本基金自2020年3月10日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 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		
方旻	本基金基金经理	2014-11-19	—	10.9	硕士，自2010年2月至2014年4月任富国基金管理有限公司定量研究员；2014年4月至2014年11月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理助理，2014年11月起任富国中证红利指数

					<p>增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2015 年 5 月至 2019 年 11 月任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数分级证券投资基金(已于 2019 年 5 月 10 日变更为富国中证银行指数型证券投资基金)的基金经理, 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理, 2017 年 6 月至 2018 年 12 月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理, 2017 年 7 月至 2020 年 9 月任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2018 年 5 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2018 年 7 月至 2020 年 9 月任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 1 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理, 2020 年 2 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 兼任量化投资部量化投资总监。具有基金从业资格。</p>
徐幼华	本基金基金经理	2011-05-13	—	15.5	<p>硕士, 曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理; 2006 年 7 月至 2008</p>

					<p>年12月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员，2009年1月至2011年5月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员、基金经理助理，2011年5月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理，2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，2015年6月至2017年12月任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金基金经理，2016年11月至2020年1月任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，2015年6月至2017年11月任富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理，2017年3月至2020年1月任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，2017年4月至2020年1月任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，2018年5月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金、富国中证1000指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，2018年7月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理，2018年12月起任富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；兼任量化投资部副总经理。具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确

定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，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

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平

性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

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，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 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。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 14 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

由于国庆期间并未出现明显负面信息，国庆后首周海外资金回流，市场大幅上涨。受欧洲及国内销量超预期、苹果 5G 手机发布等消息的刺激，新能源车、苹果产业链等科技板块表现突出。随着市场回到前期高点，估值压力再度显现，同时央行表态把好货币总闸门，市场对货币政策进一步收缩产生担忧，市场整体出现回调。11 月初，随着美国大选逐步落地，不确定性逐步消失，同时伴随着疫苗进展出现积极信号，市场风险偏好大幅提升，全球股市均出现较大幅度的上涨。11 月中旬起，市场开始担忧经济复苏后央行货币政策可能进一步收紧，同时公布的 10 月金融数据显示社融增速可能进一步放缓，导致 A 股出现调整。12 月下旬起，中央经济工作会议召开，会议部署明年经济工作时指出，明年宏观政策要保持连续性、稳定性、可持续性，政策操作上要更加精准有效、不急转弯。这一阐述打消了市场前期对于货币政策大幅收紧的担忧。同时，随着美国新一轮财政刺激政策落地，市场风险偏好明显提升，食品饮料、新能源车、军工等板块轮番上涨，前期跌幅较大的 TMT 板块也迎来反弹。12 月末，随着中欧投资协定签署，市场情绪进一步高涨，主要指数创出本轮反弹新高。总体来看，2020 年 4 季度上证综指上涨 7.92%，沪深 300 上涨 13.6%，创业板指上涨 15.21%，中证 500

指数上涨 2.82%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率 A/B 级为 4.07%，C 级为 3.98%，同期业绩比较基准收益率 A/B 级为 4.15%，C 级为 4.15%

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 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	3,761,076,477.05	90.17
	其中：股票	3,761,076,477.05	90.17
2	固定收益投资	20,253,000.00	0.49
	其中：债券	20,253,000.00	0.49
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	80,000,000.00	1.92
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	295,219,958.70	7.08
7	其他资产	14,655,138.93	0.35
8	合计	4,171,204,574.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采矿业	60,975,842.60	1.50

C	制造业	298,451,786.49	7.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,374,396.00	0.89
E	建筑业	29,815,061.00	0.73
F	批发和零售业	20,328,053.07	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	36,048,585.06	0.89
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,494.78	0.00
J	金融业	17,717,059.88	0.44
K	房地产业	52,313,375.14	1.29
L	租赁和商务服务业	26,035,995.00	0.64
M	科学研究和技术服务业	2,251,480.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	62,972.16	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	3,540,765.27	0.09
S	综合	—	—
	合计	583,979,866.45	14.36

5.2.2 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采矿业	313,318,711.14	7.70
C	制造业	1,480,020,690.14	36.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	98,004,800.21	2.41
E	建筑业	6,240,332.00	0.15
F	批发和零售业	147,310,350.28	3.62
G	交通运输、仓储和邮政业	162,535,491.77	4.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,860,331.00	0.56
J	金融业	377,058,992.50	9.27
K	房地产业	482,414,520.10	11.86
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	50,889,075.46	1.25
S	综合	36,443,316.00	0.90
	合计	3,177,096,610.60	78.10

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股票投资明细

5.3.1 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十名股票投资明细

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	601166	兴业银行	3,921,008	81,831,436.96	2.01
2	002110	三钢闽光	11,208,206	75,431,226.38	1.85
3	601003	柳钢股份	13,453,925	69,825,870.75	1.72
4	600971	恒源煤电	10,007,092	62,944,608.68	1.55
5	601636	旗滨集团	4,800,900	61,451,520.00	1.51
6	601006	大秦铁路	9,332,033	60,284,933.18	1.48
7	600985	淮北矿业	5,349,900	59,865,381.00	1.47
8	600036	招商银行	1,353,634	59,492,214.30	1.46
9	002367	康力电梯	5,885,371	57,853,196.93	1.42
10	603328	依顿电子	7,233,144	56,768,894.80	1.40

5.3.2 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

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	601888	中国中免	84,400	23,838,780.00	0.59
2	601615	明阳智能	1,145,000	21,732,100.00	0.53
3	601390	中国中铁	3,772,300	19,880,021.00	0.49
4	600782	新钢股份	4,230,600	19,418,454.00	0.48
5	601677	明泰铝业	1,342,300	18,980,122.00	0.47

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	—	—
2	央行票据	—	—
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	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	20,253,000.00	0.50
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	20,253,000.00	0.50

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	113044	大秦转债	202,530	20,253,000.00	0.50

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	—
股指期货投资本期收益(元)	—
股指期货投资本期公允价值变动(元)	—

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	—
国债期货投资本期收益（元）	—
国债期货投资本期公允价值变动（元）	—

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“兴业银行”的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保的违法违规事实，中国银保监会福建监管局于2020年8月31日对公司做出没收违法所得6,361,807.97元，并合计处以罚款15,961,807.97元的行政处罚（闽银保监罚决字〔2020〕24号）；由于存在为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违反银行卡收单外包管理规定等5项违法违规事实，中国人民银行福州中心支行于2020年9月4日对公司做出警告，没收违法所得10,875,088.15元，并处13,824,431.23元罚款的行政处罚（福银罚字〔2020〕35号）。兴业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余9名证券的发行主体本期未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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	207,132.66
2	应收证券清算款	9,848,759.59
3	应收股利	—
4	应收利息	34,347.20
5	应收申购款	4,564,899.48
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	14,655,138.93

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	603328	依顿电子	50,304,400.00	1.24	大宗交易限售

注：本基金本报告期末持有依顿电子（股票代码 603328）公允价值为 56,768,894.80 元，其中大宗交易限售股票部分公允价值为 50,304,400.00 元，剩余部分为正常流通股票。

5.11.5.2 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未持有流通受限股票。

5.11.6 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

项目	富国中证红利指数增强 A	富国中证红利指数增强 C
报告期期初基金份额总额	3,668,793,151.02	77,123,474.44
报告期期间基金总申购份额	460,401,863.17	24,031,310.59
减：报告期期间基金总赎回份额	542,513,903.39	73,409,607.88
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	3,586,681,110.80	27,745,177.15

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	980.39
报告期期间买入/申购总份额	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	980.39
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2020 年 12 月 28 日起，在本基金投资范围中增加存托凭证，并对基金合同及托管协议的相应条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2020 年 12 月 26 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下由中国工商银行股份有限公司托管的部分基金投资范围增加存托凭证、增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》及修改后的基金合同、托管协议。

§ 9 备查文件目录

9.1 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、富国中证红利指数增强型证券投资基金基金合同
- 8、富国中证红利指数增强型证券投资基金托管协议
- 9、富国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

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

9.3 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
2021 年 01 月 22 日