天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）2010年年度报告摘要

2010年12月31日

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:二〇一一年三月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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2011年3月23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。

本报告期自2010年8月12日起至2010年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘深证成份指数(LOF)
基金主代码	164205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年8月12日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
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	142,211,580.45份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年9月17日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,实现对深证成份指数的有效跟踪,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用指数复制投资策略,按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整,以复制和跟踪标的指数。 当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时,或者因特殊情况(如成份股停牌、成份股流动性受限等)导致基金无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整,并可在条件允许的情况下,辅以金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金产品中高风险、高收益的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

投资目标		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕传红	赵会军
	联系电话	022-83865568	010-66105799
	电子邮箱	lvch@thfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		022-83310988、4007109999	95588
传真		022-83865569	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.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§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	2010年8月12日(基金合同生效日)—2010年12月31日
本期已实现收益	1,451,210.01
本期利润	-724,314.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0027
本期基金份额净值增长率	-2.20%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0218
期末基金资产净值	139,108,218.39
期末基金份额净值	0.978

注:1、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(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-2.49%	0.94%	8.25%	1.83%	-10.74%	-0.89%
自基金合同生效起至今	-2.20%	0.76%	15.85%	1.66%	-18.05%	-0.90%

注:天弘深证成份指数(LOF)业绩比较基准:深证成份指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。本基金是以深证成份指数为标的的指数的被动式、指数型基金,以此为业绩比较基准,能够准确地反映本基金的投资绩效。

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

天弘深证成份指数基金(LOF)份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年8月12日至2010年12月31日)

注:1、本基金合同于2010年8月12日生效,本基金合同生效起至披露时点不满1年。

2、基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2010年8月12日至2011年2月11日,截至本报告期末,本基金仍然处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效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:本基金合同于2010年8月12日生效。基金合同生效当年2010年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配情况。

§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

天弘基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准,于2004年11月8日正式成立。注册资本金为1亿元人民币,总部设在天津,在北京、上海、广州设有分公司。公司股东为天津信托有限责任公司(持股比例48%)、兵器财务有限责任公司(持股比例26%)、内蒙古君正能源化工股份有限公司(持股比例26%)。本基金管理人目前管理六只基金:天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、天弘周期策略股票型证券投资基金、天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)、天弘添利分级债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理及基金经理助理简介

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		
徐正国	本基金基金经理;天弘精选混合型证券投资基金基金经理。	2010年8月	—	6年	男,管理学硕士,2004年加盟本公司,历任本公司交易员、行业研究员、高级研究员、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理。

注:1、上述任职日期、离任日期均为本基金管理人对外披露的任免日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《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

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定,勤勉尽责地管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内,本基金运作合法合规,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则,在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,公司制定并执行了公平交易管理办法。公平交易管理办法的范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动。

公平交易的执行情况包括:公平对待不同投资组合,严禁进行以各投资组合之间利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权审批程序;建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;实行集中交易制度和公平的交易分配制度;加强对投资交易行为的监察稽核力度等。

本报告期内,基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。

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

本基金管理人旗下没有与天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)投资风格相似的基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生法规禁止的同一基金在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2010年,宏观经济在四万亿投资的带动下,出现了加快增长态势。政策的主基调始终围绕着资产价格泡沫和通货膨胀预期进行调控。一季度,经济继续快速增长,房地产价格涨幅明显,通胀压力增大,管理层采取果断措施,包括贷款额度控制,提高存款准备金率,A股市场周期性行业股票因此出现了比较大幅的调整,创业板的推出点燃了大家对新兴产业的投资热情,中小板、创业板演绎了较多个股行情;二季度,随着调控政策逐步落实,经济增幅出现一定下滑,市场情绪趋于悲观,A股呈现单边下跌;三季度,在政府保障房和西部大开发等基建项目的拉动下,经济出现探底回升,市场也逐步走出底部,新兴产业和中小股票纷纷创出新高;四季度,在美国推行量化宽松QE2带动下,以有色金属和煤炭为领头的周期股出现较大的一波补涨行情,但是在季度后半期,由于政策紧缩力度超预期,市场出现了整体的下滑。从全年来看,A股市场呈区间震荡格局,新兴产业、消费行业、中小市值股票表现较好。

本基金从三季度末开始逐步建仓,从安全边际的角度,本基金重点配置了深证成份指数中的消费、医药类的个股,同时阶段性地参与了资源类的煤炭、有色、地产等行业。但由于建仓时指数位置较高,在后期市场大幅调整的过程中基金净值出现一定的亏损。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年12月31日,本基金份额净值为0.978元,本报告期份额净值增长率-2.20%,同期业绩比较基准增长率15.85%。

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,全球宏观经济进入复苏通道,而中国经济在过去几年过剩产能清理和结构调整的基础上逐步迎来中周期的增长阶段。而2011年是"十二五"开局元年,一方面大量的投资项目将会开工建设,另一方面,传统行业领域前几年产能扩展有限,剩余产能逐步清除,部分产业缺口逐步出现,装备制造业面临2-3年较好的需求环境。总之,经济增长无虞。

控制通货膨胀和经济结构转型则成为今年政府经济工作的两大主题,由于市场整体的估值水平已然便宜,加上增长无虞,我们判断市场会在交替反应通货膨胀和结构转型的基础上震荡上行。当通货膨胀趋紧,政府调控的压力就会很大,市场资金面就会紧缩,市场下行的压力就大;当通货膨胀得到一定的控制,市场资金面压力减轻时,市场上行的动力就较强。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策,对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督,对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、基金运营部负责人及监察稽核部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的约定。

§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

2010年,本基金托管人在对天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)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

2010年,天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)的管理人——天弘基金管理有限公司在天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)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。

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

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)2010年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。

§6 审计报告

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所审计,该所出具了"无保留意见的审计报告",且在审计报告中无强调事项。投资者可通过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:天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

姓名	附注号	本期末 2010年12月31日
资 产:		
银行存款	7.4.7.1	3,445,616.58
结算备付金		8,413,471.27
存出保证金		583,333.31
交易性金融资产	7.4.7.2	96,296,712.22
其中:股票投资		96,296,712.22
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	18,000,000.00
应收证券清算款		17,435,757.94
应收利息	7.4.7.5	6,593.44
应收股利		-
应收申购款		5,928.85
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		144,187,413.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		2,997,187.47
应付赎回款		109,233.84
应付管理人报酬		91,021.52
应付托管费		18,204.28
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	945,505.05
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	918,043.06
负债合计		5,079,195.22
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	142,211,580.45
未分配利润	7.4.7.10	-3,103,362.06
所有者权益合计		139,108,218.39
负债和所有者权益总计		144,187,413.61

注:1、报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.978元,基金份额总额142,211,580.45份。

2、本财务报表的实际编制期间为2010年8月12日(基金合同生效日)至2010年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体:天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2010年8月12日(基金合同生效日)至2010年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期2010年8月12日 (基金合同生效日)至 2010年12月31日
一、收入		2,131,455.37
1. 利息收入		1,636,658.70
其中:存款利息收入	7.4.7.11	177,142.07
债券利息收入		65.21
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,459,451.42
其他利息收入		-
2. 投资收益(损失以"-"填列)		2,292,389.38
其中:股票投资收益	7.4.7.12	2,222,895.89
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	69,493.49
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-2,175,524.09
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5. 其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	377,931.38
减:二、费用		2,855,769.45
1. 管理人报酬		778,805.52
2. 托管费		155,761.10
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,698,056.49
5. 利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	223,146.34
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-724,314.08
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-724,314.08

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2010年8月12日(基金合同生效日)至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期2010年8月12日(基金合同生效日) 至2010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)	440,630,636.78	-	440,630,636.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-724,314.08	-724,314.08
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)	-298,419,056.33	-2,379,047.98	-300,798,104.31
其中:1.基金申购款	1,517,461.47	26,508.88	1,543,970.35
2.基金赎回款	-299,936,517.80	-2,405,556.86	-302,342,074.66
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)	142,211,580.45	-3,103,362.06	139,108,218.39

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:

胡　敏	胡　敏	田　中　甲
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 重要会计政策和会计估计

7.4.1.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2010年8月12日(基金合同生效日)至2010年12月31日。

7.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量。应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,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公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.1.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.1.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.1.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.1.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.1.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)本基金该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

7.4.1.13 其他重要的会计政策和会计估计

(1)重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告[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》,本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值,通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动,停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
兵器财务有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工股份有限公司	基金管理人的股东

注:下述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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

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2010年8月12日(基金合同生效日) 至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	778,805.52
其中:支付销售机构的客户维护费	265,357.05

注:支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值X0.75%/当年天数。

7.4.3.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2010年8月12日(基金合同生效日) 至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	155,761.10

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值X0.15%/当年天数。

7.4.3.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

于本报告期间,本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.3.4各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

于本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金份额。

7.4.3.4.2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

于本报告期末,本基金基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

7.4.3.5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2010年8月12日(基金合同生效日) 至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	3,445,616.58	134,488.84

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.3.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

于本报告期内,本基金未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.3.7其他关联交易事项的说明

于本报告期内,本基金无其他关联交易事项。

7.4.4期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末,本基金无因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

7.4.4.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末,本基金未持有的暂时停牌等流通受限股票。

7.4.4.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止,本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止,本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	96,296,712.22	66.79
	其中:股票	96,296,712.22	66.79
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
	其中:权证	-	-
4	买入返售金融资产	18,000,000.00	12.48
	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	11,859,087.85	8.22
6	其他各项资产	18,031,613.54	12.51
7	合　计	144,187,413.61	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1期末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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	9,092,099.25	6.54
C	制造业	55,713,337.87	40.05
C0	食品、饮料	28,562,691.32	20.53
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	5,093,856.00	3.66
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	5,216,565.90	3.75
C7	机械、设备、仪表	7,932,452.00	5.70
C8	医药、生物制品	8,907,772.65	6.40
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	7,544,082.00	5.42
H	批发和零售贸易	10,385,234.60	7.47
I	金融、保险业	7,044,409.00	5.06
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	89,779,162.72	64.54

8.2.2期末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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	6,517,549.50	4.69
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	-	-
C8	医药、生物制品	6,517,549.50	4.69
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	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	6,517,549.50	4.69

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	000858	五 粮 液	347,644	12,038,911.72	8.65
2	002024	苏宁电器	792,766	10,385,234.60	7.47
3	000568	泸州老窖	226,384	9,259,105.60	6.66
4	000063	中兴通讯	276,340	7,544,082.00	5.42
5	000895	双汇发展	83,502	7,264,674.00	5.22
6	000792	盐湖钾肥	76,900	5,093,856.00	3.66
7	000983	西山煤电	185,400	4,948,326.00	3.56
8	002007	华兰生物	100,935	4,884,244.65	3.51
9	000060	中金岭南	193,600	4,356,000.00	3.13
10	000527	美的电器	240,700	4,188,180.00	3.01

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

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	000423	东阿阿胶	127,545	6,517,549.50	4.69

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000538	云南白药	58,647,657.03	42.16
2	000792	盐湖钾肥	51,621,006.24	37.11
3	000858	五 粮 液	50,953,981.42	36.63
4	002007	华兰生物	49,956,080.37	35.91
5	000630	铜陵有色	32,453,058.72	23.33
6	000157	中联重科	27,942,636.28	20.09
7	002202	金风科技	26,473,159.02	19.03
8	002024	苏宁电器	25,980,445.75	18.68
9	000063	中兴通讯	24,158,344.63	17.37
10	000568	泸州老窖	23,920,567.31	17.20
11	000800	一汽轿车	22,974,754.49	16.52
12	000338	潍柴动力	21,965,211.01	15.79
13	000623	吉林敖东	18,982,746.44	13.65
14	000562	宏源证券	16,981,115.49	12.21
15	000024	招商地产	16,481,461.90	11.85
16	000527	美的电器	15,988,776.44	11.49
17	000960	锡业股份	15,983,168.15	11.49
18	000002	万 科A	15,972,696.29	11.48
19	000983	西山煤电	14,972,316.97	10.76
20	000423	东阿阿胶	12,489,773.14	8.98
21	000895	双汇发展	12,031,406.58	8.65
22	002142	宁波银行	10,992,494.37	7.90
23	000937	冀中能源	10,983,486.76	7.90
24	000933	神火股份	8,994,222.98	6.47
25	000728	国元证券	8,986,718.57	6.46
26	000839	中信国安	7,990,306.53	5.74
27	000783	长江证券	6,986,132.26	5.02
28	000651	格力电器	5,997,455.30	4.31
29	000001	深发展A	3,996,063.40	2.87
30	000060	中金岭南	3,994,337.65	2.87
31	000768	西飞国际	3,991,831.76	2.87

注:本项的"买入金额"均按买入成交金额(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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000538	云南白药	58,468,272.63	42.03
2	000792	盐湖钾肥	46,463,723.52	33.40
3	002007	华兰生物	44,329,297.06	31.87
4	000858	五 粮 液	38,917,039.38	27.98
5	000630	铜陵有色	33,954,023.12	24.41
6	002202	金风科技	26,261,333.38	18.88
7	000338	潍柴动力	24,934,329.63	17.92
8	000157	中联重科	23,933,899.67	17.21
9	000800	一汽轿车	22,819,901.65	16.40
10	000063	中兴通讯	16,145,579.92	11.61
11	000024	招商地产	16,093,417.15	11.57
12	000002	万 科A	15,751,390.85	11.32
13	000568	泸州老窖	15,249,949.83	10.96
14	000623	吉林敖东	15,237,683.51	10.95
15	000960	锡业股份	14,805,201.94	10.64
16	002024	苏宁电器	13,927,054.02	10.01
17	000562	宏源证券	12,954,010.14	9.31
18	000527	美的电器	11,177,733.59	8.04
19	002142	宁波银行	11,045,361.34	7.94
20	000983	西山煤电	10,365,638.89	7.45
21	000728	国元证券	8,907,734.52	6.40
22	000933	神火股份	8,629,606.86	6.20
23	000937	冀中能源	7,388,942.57	5.31
24	000839	中信国安	7,375,474.55	5.30
25	000423	东阿阿胶	6,000,507.47	4.31
26	000651	格力电器	5,958,284.35	4.28
27	000895	双汇发展	4,397,685.08	3.16
28	000768	西飞国际	4,071,727.80	2.93
29	000001	深发展A	3,982,638.00	2.86
30	000783	长江证券	3,926,903.41	2.82

注:本项"卖出金额"均按卖出成交金额(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	630,336,958.25
卖出股票收入(成交)总额	534,087,617.83

注:本项"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(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(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	可转债	-	-
7	合　计	-	-

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

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

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报告期内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,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.9.2基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名　称	金　额(元)
1	存出保证金	583,333.31
2	应收证券清算款	17,435,757.94
3	应收股利	-
4	应收利息	6,593.44
5	应收申购款	5,928.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	合　计	18,031,613.54

8.9.4 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。

8.9.5 期末指数投资前十名股票和积极投资前五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

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

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的情况。

8.9.6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。

§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
3,570	39,835.18	8,975,773.14	6.31%	133,235,807.31	93.69%

9.2期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额	占上市总份额比例
1	沈学平	582,950.00	36.01%
2	徐吉	100,002.00	6.18%
3	左磊	73,907.00	4.56%
4	方士兰	71,300.00	4.40%
5	丁成章	70,451.00	4.35%
6	莫展桥	63,468.00	3.92%
7	袁会东	60,005.00	3.71%
8	萧浩泉	32,514.00	2.01%
9	张志赟	30,600.00	1.89%
10	胡艳萍	30,000.00	1.85%

9.3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	份额级别	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		26,800.00	0.02%
	合计	26,800.00	0.02%

§10 开放式基金份额变动

份额单位:份

基金合同生效日(2010年8月12日)基金份额总额	440,630,636.78
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,517,461.47
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	299,936,517.80
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	142,211,580.45

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会决议。

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

本报告期内本基金基金管理人、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

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应向普华永道中天会计师事务所有限公司支付服务费5万元整。截至本报告期末,普华永道中天会计师事务所有限公司已为天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)提供审计服务5个月。

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

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		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	佣金	占当期佣金总量的比例	
西藏同信证券有限责任公司	2	404,343,262.93	34.74%	328,532.76	34.74%	无
渤海证券股份有限公司	2	277,937,533.47	23.88%	225,829.30	23.88%	无
平安证券有限责任公司	1	205,619,580.56	17.67%	167,067.12	17.67%	无
北京高华证券有限责任公司	1	203,859,233.04	17.51%	165,635.77	17.51%	无
申银万国证券股份有限公司	2	41,936,251.76	3.60%	34,073.72	3.60%	无
国金证券股份有限公司	1	30,235,169.32	2.60%	24,566.80	2.60%	无
券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购		备注
		债券交易量	占债券交易总量比例	回购交易量	占回购交易总量比例	
渤海证券股份有限公司	2	-	-	6,193,800,000.00	76.03%	无
西藏同信证券有限责任公司	2	330,558.70	100.00%	1,953,000,000.00	23.97%	无

注:1、基金专用交易单元的选择标准为:该证券经营机构财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;

经营行为规范,内控制度健全,最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚;研究实力较强,能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务;

2、基金专用交易单元的选择程序:本基金管理人根据上述标准进行考察后,确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议;

3、报告期内新租用证券公司交易单元情况:

序号	证券公司名称	所属市场	数量
1	东兴证券股份有限公司	上海	1个
2	广州证券有限责任公司	上海、深圳	各1个
3	英大证券有限责任公司	上海、深圳	各1个
4	安信证券股份有限公司	深圳	1个
5	北京高华证券有限责任公司	深圳	1个
6	兴业证券股份有限公司	上海	1个
7	西藏同信证券有限责任公司	上海、深圳	各1个
8	华宝证券有限责任公司	上海	1个
9	申银万国证券股份有限公司	深圳	1个
10	光大证券股份有限公司	深圳	1个

4、本基金报告期内停止租用交易单元:无。

天弘基金管理有限公司
二〇一一年三月二十九日