

天弘精选混合型证券投资基金 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
报告送出日期:二〇一一年三月二十九日

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构、基金投资者均不承担因虚假记载、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。

2.1 基金基本情况
基金名称:天弘精选混合型证券投资基金
基金代码:420001
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2006年06月16日

2.2 基金产品说明
投资目标:本基金投资于具有良好成长性的股票、债券、货币市场工具等,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 信息披露方式
基金年度报告全文及摘要刊登于中国证监会指定网站www.tianhong.com.cn
基金年度报告摘要刊登于中国证监会指定网站www.tianhong.com.cn

3.1 主要会计数据及财务指标
基金净值增长率:2010年:31.06%,2009年:27.78%

Table with 4 columns: 基金净值增长率, 业绩比较基准, 基金净值增长率, 业绩比较基准. Rows include 2010年, 2009年, 2008年, 2007年, 2006年.

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
注: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

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
2010年:天弘精选混合型证券投资基金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

天弘精选混合型基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
0005年10月8日至2010年12月31日

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 预付款项, 其他流动资产, 其他长期资产, 资产总计.

注:1. 本基金合同于2005年10月8日生效
注:2. 本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求

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:1. 本基金合同于2005年10月8日生效
注:2. 本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求

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

4.1 基金管理人及基金基金经理情况
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

4.1.2 基金基金经理情况
基金基金经理:王亚伟
基金基金经理:陈树广

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
注: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有关规定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的行为

4.3 管理人报告期内公平交易情况的说明
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

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金本报告期未发生法律法规禁止的同一基金或不同基金组合之间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

4.3.1 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

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;在确保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与公共信息平台,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

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金本报告期未发生法律法规禁止的同一基金或不同基金组合之间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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2010年,宏观经济增长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稳增长、价格通胀和通货膨胀预期进行调控

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0.6664元。本报告期末基金份额净值增长率6.85%,同期业绩比较基准增长率-7.18%,高于基准14.03%

4.5 管理人对于宏观经济、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严产能清理和结构调整的基础上逐步迎来中长期的增长阶段

4.6 管理人对于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

4.7 管理人对于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. 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有限公司审计,该所出具了“无保留意见的审计报告”,且在审计报告中无保留事项。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文

5.1 资产负债表
会计主体:天弘精选混合型证券投资基金
报告截止日:2010年12月31日

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 预付款项, 其他流动资产, 其他长期资产, 资产总计.

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.6664元,基金总额805,490,883,322.26份

5.2 利润表
会计主体:天弘精选混合型证券投资基金
本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

Table with 2 columns: 项目, 金额. Rows include 一、收入, 利息收入, 投资收益, 公允价值变动收益, 其他业务收入, 其他收益, 二、费用, 销售费用, 管理费用, 财务费用, 其他费用, 三、利润总额, 四、净利润

注:1. 本基金合同于2005年10月8日生效
注:2. 本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求

5.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:天弘精选混合型证券投资基金
本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

Table with 2 columns: 项目, 金额. Rows include 一、期初基金份额总额, 二、报告期内基金份额变动, 三、期末基金份额总额

注:1. 本基金合同于2005年10月8日生效
注:2. 本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求

5.4 现金流量表
会计主体:天弘精选混合型证券投资基金
本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

Table with 2 columns: 项目, 金额. Rows include 一、经营活动产生的现金流量, 二、投资活动产生的现金流量, 三、筹资活动产生的现金流量, 四、现金及现金等价物净增加额

注:1. 本基金合同于2005年10月8日生效
注:2. 本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求

5.5 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:天弘精选混合型证券投资基金
本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

Table with 2 columns: 项目, 金额. Rows include 一、期初基金份额总额, 二、报告期内基金份额变动, 三、期末基金份额总额

注:1. 本基金合同于2005年10月8日生效
注:2. 本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求

注:3. 本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求

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

7.1 报表附注
7.1.1 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
本基金本报告期会计政策所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告会计政策所采用的会计政策、会计估计一致

7.1.2 关联方关系
关联方名称 关联方关系
天弘基金管理有限公司 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
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

注:下述关联方均在正常业务范围内按一般商业条款订立
7.1.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.1.3.1 通过关联方交易单元进行的交易
本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易

7.1.3.2 基金管理费
单位:人民币元
当期发生的基金应支付的基金管理费 50,728,465.61 51,511,304.72

注:支付基金管理费天弘基金管理有限公司的托管人报酬按前一日基金资产净值1.5%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:日管理费=报酬前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数

7.1.3.2.2 基金托管费
单位:人民币元
当期发生的基金应支付的托管费 4,464,777.97 4,420,484.14

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0.25%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 X 0.25% / 当年天数

7.1.3.3 与关联方进行银行同业拆借市场的债券回购交易
单位:人民币元
本期(2010年1月1日至2010年12月31日)

7.1.3.4 各关联方投资本基金的情况
7.1.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本基金管理人本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金份额

7.1.3.4.2 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
本基金管理人本期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

7.1.3.5 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 2010年12月31日 2009年12月31日

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
7.1.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券

7.1.3.7 其他关联方交易事项的说明
本基金本期及上年度可比期间无其他关联方交易事项
7.1.4 期末 2010年12月31日 本基金持有的流通受限证券
7.1.4.1 因认购被限售证券而于期末持有的流通受限证券

7.1.4.1.1 流通受限股票
7.1.4.1.2 流通受限债券

注:本基金截至2010年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌

7.1.4.2 期末持有暂时停牌等流通受限股票
单位:人民币元
股票代码 股票名称 停牌原因 初始确认日期 数量 期末公允价值 期末账面价值

注:本基金截至2010年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌

7.1.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的资产
7.1.4.3.1 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资产

7.1.4.3.2 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资产

8.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元
序号 类别 金额 占基金总资产比例(%)

8.2 期末按行业分类的股票投资组合
单位:人民币元
代码 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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
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(%)

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初基金资产净值2%或前20名的股票明细
单位:人民币元

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
单位:人民币元

注:本表的“买入金额”均按买入成交金额(成交价款)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初基金资产净值2%或前20名的股票明细
单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期买入金额(元), 占基金资产净值比例(%)

注:本表“卖出金额”均按卖出成交金额(成交价款)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
买入股票的成本总额 8,129,499.74

注:本表“买入股票成本”,“卖出股票收入”均按买入卖出成交金额(成交价款)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(%)

8.6 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
金额单位:人民币元
序号 债券代码 债券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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序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股票中,没有在流通受限期间内,存在流通受限的情况

8.9.2 其他资产构成
单位:人民币元
序号 名称 金额(元)

8.9.3 投资组合报告附注
8.9.3.1 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有在流通受限期间内,存在流通受限的情况

8.9.3.2 其他资产构成
单位:人民币元
序号 名称 金额(元)

8.9.3.3 投资组合报告附注
8.9.3.3.1 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有在流通受限期间内,存在流通受限的情况

8.9.3.3.2 其他资产构成
单位:人民币元
序号 名称 金额(元)

8.9.3.3.3 投资组合报告附注
8.9.3.3.3.1 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有在流通受限期间内,存在流通受限的情况

8.9.3.3.3.2 其他资产构成
单位:人民币元
序号 名称 金额(元)

8.9.3.3.3.3 投资组合报告附注
8.9.3.3.3.3.1 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有在流通受限期间内,存在流通受限的情况

8.9.3.3.3.3.2 其他资产构成
单位:人民币元
序号 名称 金额(元)

8.9.3.3.3.3.3 投资组合报告附注
8.9.3.3.3.3.3.1 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有

8.9.3.3.3.3.3.2 其他资产构成
单位:人民币元
序号 名称 金额(元)

8.9.3.3.3.3.3.3 投资组合报告附注
8.9.3.3.3.3.3.3.1 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有

8.9.3.3.3.3.3.3.2 其他资产构成
单位:人民币元
序号 名称 金额(元)

8.9.3.3.3.3.3.3.3 投资组合报告附注
8.9.3.3.3.3.3.3.3.1 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有

8.9.3.3.3.3.3.3.3.2 其他资产构成
单位:人民币元
序号 名称 金额(元)

8.9.3.3.3.3.3.3.3.3 投资组合报告附注
8.9.3.3.3.3.3.3.3.3.1 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有

8.9.3.3.3.3.3.3.3.3.2 其他资产构成
单位:人民币元
序号 名称 金额(元)