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:二〇一二年三月二十六日

天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)

2011 年度 报告摘要

2011年12月31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 2012年3 月 20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2011年1月1日起至2011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),场内简称天弘深成。
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	108,576,438.91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

项目		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	022-83310208	010-66105799
	电子邮箱	lveh@thfund.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	2011年	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	-5,110,413.32	1,451,210.01
本期利润	-30,820,949.01	-724,314.08
加权平均基金份额本期利润	-0.2624	-0.0027
本期基金份额净值增长率	-28.12%	-2.20%
3.1.2 期末数据和指标	**2011年末**	**2010年末**
期末可供分配基金份额利润	-0.2966	-0.0218
期末基金资产净值	76,370,144.50	139,108,218.39
期末基金份额净值	0.703	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

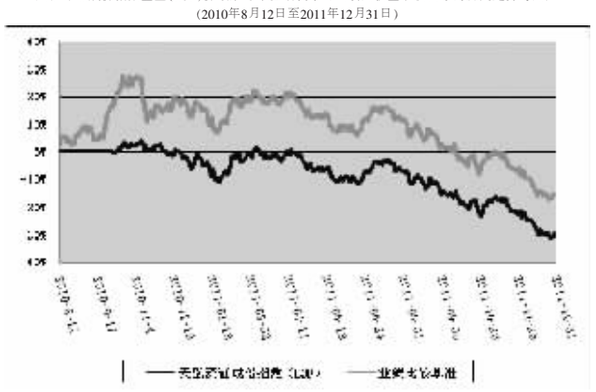
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-13.00%	1.39%	-12.69%	1.42%	-0.31%	-0.03%
过去六个月	-25.13%	1.30%	-25.16%	1.32%	0.03%	-0.02%
过去一年	-28.12%	1.29%	-27.10%	1.31%	-1.02%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-29.70%	1.17%	-15.54%	1.42%	-14.16%	-0.25%

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2011年12月31日)

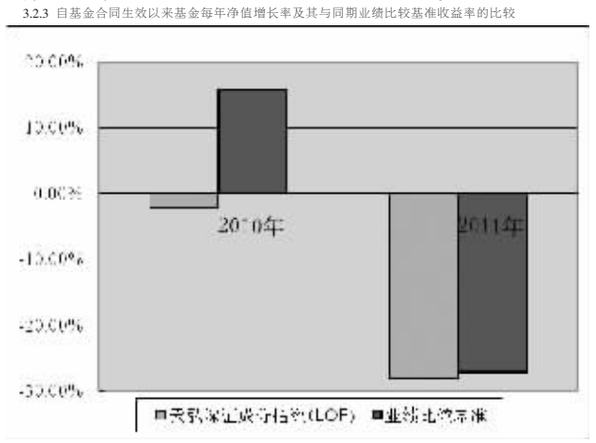


注:1、本基金合同于2010年8月12日生效。

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,建仓期结束时,各项资产配置比例符合基金合同约定。

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。

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。本公司股东为天津信托有限责任公司(持股比例48%)、内蒙古君正能源化工股份有限公司(持股比例36%)、芜湖高新投资有限公司(持股比例16%)。基金管理人目前管理七只基金: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、天弘丰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;天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理。	2010年8月	—	7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、天弘精选混合型证券投资基金基金经理。

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

2011年,主要发达国家(美国、德国等)的经济在宽松货币政策的背景下稳步复苏,但是欧债危机却不断深化,这给中国经济的出口带来较大的不确定性。2011年,由于国际宽松带来的油价上涨,国内强大的刺激政策带来的资产价格大幅上涨最终传导到消费品价格上来,通货膨胀压力巨大,管理层采取一系列宏观调控措施,包括2次加息,6次提高准备金率等,信贷规模基本得到控制,而宏观经济在紧缩的压力出现了去库存和终端放缓迹象,经济增速出现一定的下滑,通货膨胀预期基本得到管理。

回顾2011年的行情,A股整体上呈现较大的单边下跌特征。估值泡沫的创业板和部分中小板出现了更大幅度的下跌,而以银行为代表的估值偏低的大盘蓝筹股则表现了较好的抗跌特征。

本基金跟踪深证成份指数,力争使得跟踪误差最小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年12月31日,本基金份额净值为0.703元,本报告期份额净值增长率-28.12%,同期业绩比较基准增长率-27.10%。报告期内,日均跟踪误差为0.1108%,年化跟踪误差为1.7311%。

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,通货膨胀已经得到控制,房价也出现部分松动,经济下滑最快的阶段已经过去,目前经济处于筑底过程。由于通货膨胀和房价得到控制,未来政策将在保持经济平稳运行和防止通货膨胀重新抬头的平衡中决策,从中国经济长期增长前景来看,仍然非常乐观,主要是中国劳动力的比较优势仍然存在,经济转型也在有条不紊的进行,技术进步和制度变革不断推动劳动生产率提升。

从上一轮IT泡沫阶段的指数点位算起,上证指数十年零涨幅,但是我们发现代表中国经济中坚企业的深证成指十年来却涨了大约1倍。站到今天来看,那些估值偏低,核心竞争力显著的优势在未来仍然能够分享到中国经济增长的成果。

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

2011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

2011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。本报告期内,天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)未进行利润分配。

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)2011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:2011年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	5,789,719.88	3,445,616.58
结算备付金		-	8,413,471.27
存出保证金		298,528.51	583,333.31
交易性金融资产	7.4.7.2	71,443,602.00	96,296,712.22
其中:股票投资		71,443,602.00	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	1,271.54	6,593.44
应收股利		-	-
应收申购款		593.59	5,928.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		77,533,715.52	144,187,413.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日	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		13,112.50	109,233.84
应付管理人报酬		50,343.06	91,021.52
应付托管费		10,068.61	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	1,090,046.85	918,043.06
负债合计		1,163,571.02	5,079,195.22
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	108,576,438.91	142,211,580.45
未分配利润	7.4.7.10	-32,206,294.41	-3,103,362.06
所有者权益合计		76,370,144.50	139,108,218.39
负债和所有者权益总计		77,533,715.52	144,187,413.61

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值0.703元,基金份额总额108,576,438.91份。

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:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 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		-29,145,493.76	2,131,455.37
1. 利息收入		54,572.60	1,636,658.70
其中:存款利息收入	7.4.7.11	53,531.49	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		1,041.11	1,459,451.42
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以"-"填列)		-3,533,924.52	2,292,389.38
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-4,481,136.87	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	947,212.35	-
3. 公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-25,710,535.69	-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	44,393.85	377,931.38
减:二、费用		1,675,455.25	2,855,769.45
1. 管理人报酬		794,677.20	778,805.52
2. 托管费		158,935.40	155,761.10
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	295,954.21	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	425,888.44	223,146.34
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-30,820,949.01	-724,314.08
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-30,820,949.01	-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:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期2011年1月1日至2011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)	142,211,580.45	-3,103,362.06	139,108,218.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-30,820,949.01	-30,820,949.01
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)	-33,635,141.54	1,718,016.66	-31,917,124.88
其中:1.基金申购款	5,316,702.10	-553,041.46	4,763,660.64
2.基金赎回款	-38,951,843.64	2,271,058.12	-36,680,785.52
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)	108,576,438.91	-32,206,294.41	76,370,144.50
项目	上年度可比期间 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:

郭 树 强 崔 德 广 薄 贺 龙

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报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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
兵器财务有限责任公司	基金管理人的原股东(2011年12月8日前)
天津信托有限责任公司	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
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东(2011年12月8日起)

注:1、根据本基金的基金管理人2011年12月8日发布的公告,经中国证监会证监许可[2011]1625号文核准,本基金的基金管理人原股东兵器财务有限责任公司将持有本基金的基金管理人10%股权转让给内蒙古君正能源化工股份有限公司、16%股权股权转让给芜湖高新投资有限公司。股权转让完成后,本基金的基金管理人于公告日前完成了相关工商登记变更手续。

2、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

本基金本期及上年度可比期间日2010年8月12日(基金合同生效日)至2010年12月31日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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 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	794,677.20	778,805.52
其中:支付销售机构的客户维护费	366,769.97	265,357.05

注:1、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。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.3.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 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	158,935.40	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

本基金本期及上年度可比期间2010年8月12日(基金合同生效日)至2010年12月31日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

本基金管理人本期及上年度可比期间2010年8月12日(基金合同生效日)至2010年12月31日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

本基金本期末及上年度末除基金基金管理人之外的其他关联方未投资及持有本基金份额。

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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	5,789,719.88	45,970.30	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

本基金本期及上年度可比期间2010年8月12日(基金合同生效日)至2010年12月31日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

本基金本期及上年度可比期间2010年8月12日(基金合同生效日)至2010年12月31日无其他关联交易事项。

7.4.4期末(2011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

截至本报告期末(2011年12月31日),本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.4.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000768	西飞国际	2011-12-28	证监会审核公司资产重组事宜	7.26	2012-1-4	7.61	111,005	1,237,198.61	805,896.30	

注:本基金截至2011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。

7.4.4.3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(2011年12月31日),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(2011年12月31日),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	71,443,602.00	92.15
	其中:股票	71,443,602.00	92.15
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	-	-
	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	5,789,719.88	7.47
6	其他各项资产	300,393.64	0.39
7	合 计	77,533,715.52	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	4,575,570.44	5.99
C	制造业	42,319,512.88	55.41
C0	食品、饮料	12,656,172.97	16.57
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	1,566,849.70	2.05
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	9,350,749.22	12.24
C7	机械、设备、仪表	13,276,666.84	17.38
C8	医药、生物制品	5,469,074.15	7.16
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	2,957,043.70	3.87
H	批发和零售贸易	3,489,568.64	4.57
I	金融、保险业	8,977,125.76	11.75
J	房地产业	7,404,461.84	9.70
K	社会服务业	1,720,318.74	2.25
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	71,443,602.00	93.55

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	-	-
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	-	-
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	-	-

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000002	万 科A	807,087	6,028,939.89	7.89
2	000858	五 粮 液	173,341	5,685,584.80	7.44
3	000001	深发展A	251,697	3,923,956.23	5.14
4	002024	苏宁电器	413,456	3,489,568.64	4.57
5	000651	格力电器	194,001	3,354,277.29	4.39
6	000157	中联重科	388,252	2,985,657.88	3.91
7	000063	中兴通讯	174,973	2,957,043.70	3.87
8	000568	泸州老窖	66,790	2,491,267.00	3.26
9	002304	洋河股份	18,476	2,382,849.72	3.12
10	000423	东阿阿胶	52,172	2,240,787.40	2.93

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票明细。

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

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科A	10,145,029.76	7.29
2	000960	锡业股份	8,344,197.65	6.00
3	000878	云南铜业	6,044,920.01	4.35
4	000001	深发展A	5,373,006.98	3.86
5	000060	中金岭南	5,109,274.00	3.67
6	000338	潍柴动力	4,973,895.83	3.58
7	000651	格力电器	4,878,630.50	3.51
8	000024	招商地产	4,397,306.52	3.16
9	000039	中集集团	4,070,899.00	2.93
10	002202	金风科技	3,438,752.18	2.47
11	000776	广发证券	3,378,708.00	2.43
12	000629	攀钢钒钛	2,991,919.00	2.15
13	000630	铜陵有色	2,714,267.50	1.95
14	000069	华侨城A	2,570,639.65	1.85
15	002304	洋河股份	2,433,249.44	1.75
16	000983	西山煤电	2,237,084.00	1.61
17	000402	金 融 街	2,159,148.01	1.55
18	000538	云南白药	2,082,459.00	1.50
19	000709	河北钢铁	2,077,655.63	1.49
20	000012	南 玻A	1,977,942.00	1.42

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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	6,910,773.60	4.97
2	000960	锡业股份	6,695,338.64	4.81
3	002024	苏宁电器	6,358,795.90	4.57
4	000060	中金岭南	6,228,287.60	4.48
5	000858	五 粮 液	6,049,249.64	4.35
6	000024	招商地产	4,887,420.13	3.51
7	000895	双汇发展	4,471,093.16	3.21
8	000423	东阿阿胶	4,062,195.30	2.92
9	000063	中兴通讯	3,814,566.07	2.74
10	000878	云南铜业	3,601,191.20	2.59
11	000002	万 科A	3,277,556