

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:二〇一二年八月二十九日

1.1 重要提示
基金管理人的董事会对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法律责任。
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2012年8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。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告期自2012年1月1日起至2012年6月30日止。

Table with 2 columns: Section (e.g., 2.1 基金基本情况), Content (Fund details like name, dates, manager info).

Table with 2 columns: Section (e.g., 2.2 基金产品说明), Content (Investment objectives, strategies, and risk indicators).

Table with 2 columns: Section (e.g., 2.3 基金管理人及基金托管人), Content (Names and contact info for management and custody).

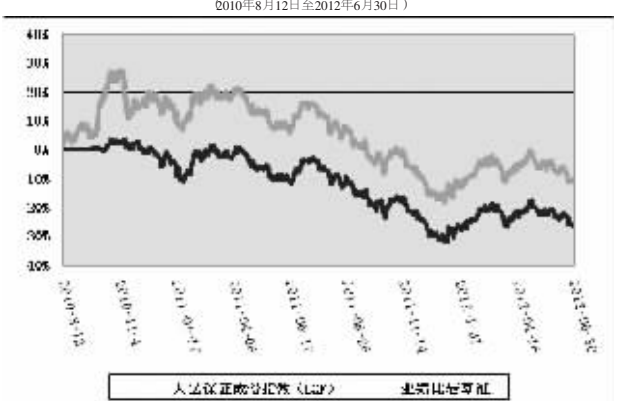
Table with 2 columns: Section (e.g., 2.4 信息披露方式), Content (Website and office address for fund information).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.1 主要会计数据和财务指标), Content (Key financial metrics and performance indicators).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.1.1 本期已实现收益), Content (Detailed financial data for the period).

注:1.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。
3.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.2 基金净值表现), Content (Performance comparison charts and data for the fund).



注:1.本基金成立于2010年8月12日生效。
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。

4.1 基金管理人及基金经营情况
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 基金基金经理及基金经理助理简介

Table with 4 columns: Name, Position, Tenure, and Explanation of duties for fund managers and assistants.

注:1.上述任职日期、聘任日期均为本基金管理人对外披露的聘任日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会、证券业协会、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投资运作遵守信用的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和相关法律法规,基金合同的有效规定,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。

4.3 管理人报告期内公平交易制度的专项说明
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,在投资决策和执行各个环节保证公平交易原则的严格执行。

4.3.2 异常交易的专项说明
公平交易的执行情况包括:公平对待不同投资组合,严禁利用各自投资组合之间的利益输送为目的的投资交易活动;在符合法律法规的前提下,严格执行公平交易制度,建立统一的研究平台和公共信息平台,确保各投资组合的投资决策、执行集中统一,严格执行公平交易制度;建立不同投资组合投资信息的隔离及保密机制,保证不同投资组合经理之间的大非公开投资信息的相互隔离;加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监测和公平交易评估体系等。

4.4 管理人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
本基金按照合同约定的资产配置比例,从上半年开始取得较好结果。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2012年6月30日,本基金份额净值0.744元,本报告期份额净值增长率5.83%,同期业绩比较基准增长率6.27%。

4.5 管理人对于宏观环境、证券市场及行业走势的判断和展望
我们观察到上半年两个月连续对下称下调整,市场情绪低落,宏观经济、政策预期、流动性预期、估值预期均处于低位。
4.6 报告期内基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.6.1 基金管理人履行各自职责的情况
本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》及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。

4.6.2 基金托管人履行各自职责的情况
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8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。

4.6.3 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
基金管理人及基金托管人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》及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。

4.6.4 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
基金管理人及基金托管人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》及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。

4.6.5 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
基金管理人及基金托管人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》及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。

4.6.6 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
基金管理人及基金托管人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》及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。

4.6.7 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
基金管理人及基金托管人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》及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。

天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

本报告期末,本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务。
4.7 管理人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,符合相关法律法规的规定。

5.1 报告期内本基金托管人遵守信用的说明
2012年上半年,本基金托管人在对天弘深证成份指数证券投资基金的托管过程中,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守信用的、净值计算、利润分配等情况的说明
2012年上半年,天弘深证成份指数证券投资基金的托管人——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,在重要方面的运作严格按照基金合同的有关规定执行。

5.3 托管人对半年度报告中基金净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等情况的说明
本托管人依据对天弘基金管理有限公司编制的天弘深证成份指数证券投资基金2012年半年度报告中财务数据、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。

6.1 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:2012年6月30日
单位:人民币元

Balance Sheet table showing assets and liabilities as of June 30, 2012.

6.2 利润表
会计主体:天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)
报告截止日:2012年6月30日
单位:人民币元

Income Statement table showing revenue and expenses for the period ending June 30, 2012.

6.3 所有者权益变动表
会计主体:天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)
报告截止日:2012年6月30日
单位:人民币元

Equity Movement Statement table showing changes in net assets for the period ending June 30, 2012.

6.4 现金流量表
会计主体:天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)
报告截止日:2012年6月30日
单位:人民币元

Cash Flow Statement table showing cash flows for the period ending June 30, 2012.

6.5 所有者权益变动表的补充说明
6.5.1 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.2 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.3 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.4 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.5 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.6 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.7 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.8 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.9 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.10 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.11 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.12 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.13 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.14 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.15 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.16 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.17 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.18 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.19 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.20 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.21 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.22 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.23 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.24 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.25 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.26 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

6.5.27 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明
6.5.28 报告期内基金资产组合的投资策略和业绩表现的说明

7.1 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
7.3 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

Table of stock holdings as of June 30, 2012, including stock names, quantities, and values.

7.2 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
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 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

Table of stock purchases and sales during the reporting period.

7.4.2 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
7.4.3 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

Table of stock sales during the reporting period.

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.6 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

Table of bond holdings as of June 30, 2012.

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
7.8 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

Table of asset-backed securities and warrants as of June 30, 2012.

7.9 投资组合报告附注
7.9.1 报告期内未发生本基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,未发生被编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
7.9.2 本基金投资的前十名证券,均为符合相关规定条件的股票。

7.9.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

Table of other assets as of June 30, 2012.

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.6 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.8 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.10 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.12 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.14 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.16 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.18 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.19 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.20 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.22 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.23 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.24 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.25 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.26 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.27 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.28 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.29 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.30 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.31 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.32 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.33 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.34 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.35 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.36 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.37 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.38 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.39 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.40 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.41 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.42 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.43 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.44 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.45 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.46 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.47 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.9.48 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.49 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

天弘基金 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:二〇一二年八月二十九日

天弘基金 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:二〇一二年八月二十九日

天弘基金 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:二〇一二年八月二十九日

天弘基金 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:二〇一二年八月二十九日