

天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

		金额单位：人民币元	
代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	1,688,898.26	2.88
C	制造业	33,751,430.28	57.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	820,271.62	1.40

G	交通运输、仓储和邮政业	2,052,379,982	4.32
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	--	--
J	金融业	8,672,649.56	14.77
K	房地产业	6,748,188.62	11.49
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	1,236,013.00	2.10
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	--	--
S	综合	--	--
	合计	55,570,049.96	94.63
5.2.2 报告期末 根据投资 账列行业分类的股票投资组合			
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	--	--
C	制造业	--	--
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	--	--
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--

J	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
K	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-
5.3	期末按公允价值计值基金资产净值比例大小排序的股票投资明细		
5.3.1	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



5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现存在报告期内前一天内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 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。

5.8.3 期末其他各项资产构成

		单位：人民币元
序号	名称	金额
1	存出保证金	1,790.99
2	应收证券清算款	274,148.90
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	934.75
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	286,035.03

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 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不存在流通受限情况。

5.8.5.2 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不存在流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述事项

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在误差。	
§ 6 开放式基金份额变动	
	单位:份
本报告期初基金份额总额	92,845,444.51
本报告期基金份额申购总额	1,989,138.20
减:本报告期基金份额赎回总额	4,167,167.92
本报告期基金份额变动份额	-
本报告期末基金份额总额	90,667,414.79
§ 7 备查文件目录	
7.1 备查文件目录	
1、中国证监会核准本基金证券投资指数基金 LOF 募集的文件	
2、天弘深证成指证券投资指数基金 LOF 基金合同	
3、天弘深证成指证券投资指数基金 LOF 招募说明书	
4、天弘深证成指证券投资指数基金 LOF 托管协议	
5、天弘基金管理有限公司批准或授权、营业执照及公司章程	
6、报告期内指定报刊上披露的各项公告	
7、办公地址	
天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 C 座 16 层	
7.2 查阅方式	
投资者可到基金管理人住所或网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件,在支付工本费后有权取得上述文件的复制件或复印件。	
公司网站: www.fundam.com.cn	

5.3 报告期末按公允价值计量的金融资产公允价值大小排名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	占基金资产净值比例 (%)
1	002604	龙力生物	257,819	5,112,550.77	7.06
2	600084	中钢股份	1,292,554	5,092,662.76	7.03
3	002483	润邦股份	498,753	5,067,635.28	7.00
4	600499	科达机电	244,500	4,912,005.00	6.78
5	002283	天润曲轴	849,971	4,887,333.25	6.75
6	600171	上海贝岭	499,901	4,514,106.33	6.23

7	002358	森源电气	205,132	4,410,338.00	6.09
8	601100	恒立油缸	253,893	3,069,567.36	4.24
9	002371	七星电子	135,021	2,904,301.71	4.01
10	000869	张 裕 A	105,679	2,855,333.00	3.94
5.4 报告期末按品种分类的前十大债券投资组合					
本基金本报告期末未持有债券。					
5.5 报告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组合					
本基金本报告期末未持有债券。					
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。					
5.7 报告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组合明细					
本基金本报告期末未持有权证。					
5.8 报告期末投资附注					
5.8.1 本报告期末无发现基金投资组合前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,也未发现报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。					
5.8.2 基金投资组合前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。					
5.8.3 期末其他各项资产构成					
					单位:人民币元
序号	名称		金额		
1	存出保证金		83,862.76		
2	应收证券清算款		785,169.02		
3	应收股利		-		
4	应收利息		1,152.01		
5	应收申购款		628,707.28		
6	其他应收款		-		
7	待摊费用		-		
8	其他		-		
9	合计		1,498,891.07		
5.8.4 报告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。					
5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。					
5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述说明					
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。					
基金品牌标识 开放式基金份额变动					
					单位:

本报告期初基金份额总额	62,111,801.51
本报告期基金总申购份额	14,042,424.77
减：本报告期基金总赎回份额	9,892,187.62
本报告期基金拆分变动份额	--
本报告期末基金份额总额	66,262,038.66

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

5 备查文件目录

1. 备查文件目录
 1. 中国证监会批准天弘周期策略股票型证券投资基金募集的文件
 2. 天弘周期策略股票型证券投资基金基金合同
 3. 天弘周期策略股票型证券投资基金招募说明书
 4. 天弘周期策略股票型证券投资基金基金托管协议
 5. 天弘基金管理有限公司内部合规文件、基金执照及公司章程
 6. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告
 7. 存放地点
天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层
 - 7.3 查阅方式
投资者可至基金管理人、住所及网站或基金托管人的住所查阅备查文件，在支付本费用后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。

公司网站 www.tfhund.com

二〇一四年三月二十二日