

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:二〇一三年三月二十九日
§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人、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。

基金管理人和中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月26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。

本年度报告摘要自年度报告正本出具之日起，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012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:103,568,905.76份

基金份额净值:1.056

基金份额净值变动率:1.056%

基金份额净值单位:人民币元

上市日期:2010年9月17日

2.2 基金产品说明

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。

本基金为被动型指数基金，采用指数复制型投资策略，按照成份股在标的指数中的权重构造股票组合，定期调整组合构成以使其更符合标的指数的构成及其权重的变动进行相应的调整，以复制标的指数。

当预期成份股调整和新股将发生时，或者因特殊情况(如成份股停牌、配股、增发等)进行时，或者因成份股流动性受限(导致成份股无法有效跟踪)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，并在条件允许的情况下，通过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。

深证成份指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

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

姓名 薛健林 赵会军

信息披露负责人 联系电话 022-83310208 010-66105799

电子邮箱 service@hfund.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

登载基金年度报告的管理人互联网网址:www.hfund.com.cn

基金管理人及基金托管人的办公地址:天弘基金管理有限公司,中国工商银行股份有限公司

§ 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 2012年 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 -4,276,453.47 -5,110,413.32 1,451,210.01

本期利润 1,939,839.78 -30,820,949.01 -724,314.08

加权平均基金份额本期利润 0.0182 -0.2624 -0.0027

本期基金份额净值增长率 2.56% -28.12% -2.20%

3.1.2 期末数据和指标 2012年末 2011年末 2010年末

期末可供基金份额利润 -0.2793 -0.2966 -0.0218

期末基金份额净值 74,644,994.68 76,370,144.50 139,108,218.39

期末基金份额净值 0.721 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，计算费用后实际收益水平将低于所列示数据。

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和相关费用后的余额，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减负债后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的比较

阶段 份额净值增长① 累计净值增长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 5.26% 1.29% 4.82% 1.26% 0.44% 0.03%

过去六个月 -3.09% 1.33% -4.84% 1.32% 1.75% 0.01%

过去一年 2.56% 1.35% 1.12% 1.36% 1.44% -0.01%

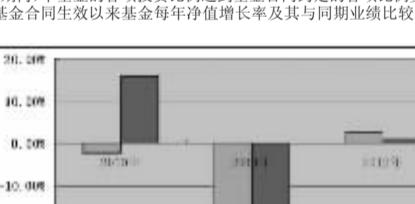
自基金合同生效起至-27.90% 1.25% -14.59% 1.39% -13.31% -0.14%

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，以此为基准进行比较基准，能够准确地反映本基金的投资收益。

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图

2010年8月12日至2012年12月31日



注:1.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(以下简称“公司”)或“本公司”经中国证监会证监基字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本为18亿元人民币，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%)、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%)。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%)、内蒙古君正能源化工有限公司(持股比例36%)、芜湖高新投资有限公司(持股比例16%)。

截至2012年12月31日，本公司管理十只基金，天弘深证成份指数证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘深证成份指数证券投资基金、天弘深证成份指数证券投资基金、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、天弘现金管理混合型证券投资基金、天弘安泰债券型混合型证券投资基金。

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

李蕴焯 2012年3月 - 6年 男，理学硕士，历任亚洲证券有限公司基金经理，天弘深证成份指数证券投资基金基金经理，天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理。

徐正国 2010年8月 2012年3月 8年 男，管理学硕士，2000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，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基金经理，天弘丰利分级债券型证券投资基金、天弘现金管理混合型证券投资基金。

注:1.上述任职日期、离任日期均为本基金经理人对外披露的任职日期。

2.证券从业人员的从业资格由行业协会从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，不存在违法违纪及未履行基金合同承诺的情况。

本基金报告期内，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，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内基金业绩的专项说明

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则，公平交易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及授权、研究分析、投资决策、交易执行、行业评估等投资管理活动相关的各个环节。

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。

本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。

本年度报告摘要自年度报告正本出具之日起，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§ 5 管理人报告

5.1 基金管理人报告期内基金运作情况说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规，不存在损害基金持有人利益的行为。

本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。

本年度报告摘要自年度报告正本出具之日起，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

5.2 基金管理人对旗下基金进行投资运作的公平性说明

基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则，公平交易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及授权、研究分析、投资决策、交易执行、行业评估等投资管理活动相关的各个环节。

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。

本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。

本年度报告摘要自年度报告正本出具之日起，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

5.3 基金管理人对旗下基金进行投资运作的公平性说明

基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则，公平交易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及授权、研究分析、投资决策、交易执行、行业评估等投资管理活动相关的各个环节。

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。

本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。

本年度报告摘要自年度报告正本出具之日起，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

5.4 基金管理人对旗下基金进行投资运作的公平性说明

基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则，公平交易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及授权、研究分析、投资决策、交易执行、行业评估等投资管理活动相关的各个环节。

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。

本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。

本年度报告摘要自年度报告正本出具之日起，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

5.5 基金管理人对旗下基金进行投资运作的公平性说明

基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则，公平交易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及授权、研究分析、投资决策、交易执行、行业评估等投资管理活动相关的各个环节。

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。

本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。

本年度报告摘要自年度报告正本出具之日起，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

5.6 基金管理人对旗下基金进行投资运作的公平性说明

基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则，公平交易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及授权、研究分析、投资决策、交易执行、行业评估等投资管理活动相关的各个环节。