

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:二〇一三年八月二十七日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示  
基金管理人的董事会、监事会对本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的完整性、准确性及完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并将董事长签发。

基金管理人已按照诚实信用、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摘要。

本半年度报告摘要摘录于半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告内含财务未审计数据。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)
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	95,265,460.21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

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。

本基金为被动指数基金，采用指数复制的投资策略，按照一定比例的权重将基金资产投资于深证成份指数成份股，以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时成份股将发生分红、配股、增发等行为时，或者因特殊情况下(如成份股停牌、成份股流动性受限)导致基金无法有效复制跟踪标的指数时，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，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。

4.7 管理人报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的约定。

# 天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)

## 2013 年度报告摘要

本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，有效维护投资者的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、研究总监及监察稽核部负责人组成。

基金管理人已将诚信原则、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摘要。

本半年度报告摘要摘录于半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告内含财务未审计数据。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§ 3 基金简介

3.1 主要财务指标和基金净值表现

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标

2013年1月1日—2013年6月30日

本期已实现收益 -6,639,704.36

加权平均基金份额本期利润 -0.1035

本期基金份额净值增长率 -14.98%

2013年6月30日

期末可分配基金份额利润 -0.3869

期末基金份额净值 58,403.9760

期末基金份额净值增长率 0.613

3.1.3 累计本期指标

2013年6月30日

基金份额累计净值增长率 -38.70%

注：1.所述基金份额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用等)；2.本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用。

3.期间可供分配利润系指期末资产负债表中“未分配利润”与“利润分配”之和；4.期末可供分配利润系指期末可供分配的利润减去本报告期已分配利润后的金额。

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

金额单位：人民币元

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的历史走势图

(2010年8月12日至2013年6月30日)

注：1.本基金合同于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 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。注册资本为1亿元人民币，总部设在北京，上海、广州设有分公司。公司股东为天津天弘信德投资有限公司(持股比例48%)、内蒙古自治区能源投资有限公司(持股比例36%)、芜湖新高投资有限公司(持股比例16%)。截至2013年6月30日，本基金管理人管理一只基金：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、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、天弘深证成份指数证券投资基金、天弘安康养老保险基金。

4.1.2 基金经理及基金经理简介

4.1.3 基金管理人对本基金的管理情况

本基金按照行业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约定的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的专项说明

本基金按照行业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约定的情况。

4.3 管理人对报告期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

公平交易执行情况的说明：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机会；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间以进行利益输送为目的的投资交易；在公平对待各投资组合的投资决策及操作相对独立的原则下，严格执行公平交易制度；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，不存在因基金份额持有人利益而进行的不公平交易。

4.3.2 管理人对公平交易制度的执行情况

公平交易执行情况的说明：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机会；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间以进行利益输送为目的的投资交易；在公平对待各投资组合的投资决策及操作相对独立的原则下，严格执行公平交易制度；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，不存在因基金份额持有人利益而进行的不公平交易。

4.3.3 管理人对异常交易的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，制定严格交易监控和报告办法对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为进行界定，拟订相应的监控、分析和控制措施。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在因基金份额持有人利益而进行的不公平交易。

4.3.4 管理人对公平交易制度的执行情况

公平交易执行情况的说明：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机会；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间以进行利益输送为目的的投资交易；在公平对待各投资组合的投资决策及操作相对独立的原则下，严格执行公平交易制度；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，不存在因基金份额持有人利益而进行的不公平交易。

4.3.5 管理人对报告期内基金的投资运作遵规守信情况的说明

本基金按照行业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约定的情况。

4.3.6 管理人对报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日，本基金份额净值为0.613元，本报告份额净值增长率-14.98%，同期业绩比较基准增长率-14.81%。报告期内，内均跟踪误差0.1266%，年化跟踪误差为1.9533%。

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，虽然短期国家对经济下行容忍度下降，但从长期来看，伴随经济转型过程中传统行业扩张动力减弱，经济下行趋势较为确定，同时通胀的紧缩趋势从未来两个季度看将仍然存在，下半年将重点关注周期性行业，二三季度我们提出关注的新一轮政府经济下行的容忍度是否在位，目前已经基本看到，但调控政策以结构调整为主没有任何悬念，但这一政策从目前看并非一步到位的政策，我们对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.6 管理人对报告期内基金估值政策的说明

公司设立的基金估值委员会为本基金估值的决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对旗下基金已采用的估值政策、方法、流程及执行情况履行审核监督，对经营环境或市场变化等导致需要调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审批基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确

3.3 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

7.3.1 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	000651	格力电器	655,325	6,454,951.25	11.05
2	000651	格力电器	177,005	4,435,745.30	7.59
3	000001	平安银行	334,210	3,332,073.70	5.71
4	000858	五粮液	143,197	2,869,667.88	4.91
5	000776	广发证券	203,617	2,256,076.36	3.86
6	000527	美的电器	155,722	1,934,067.24	3.31
7	000805	双汇发展	50,097	1,925,728.68	3.30
8	000663	中兴通讯	145,303	1,852,613.25	3.17
9	000538	云南白药	21,670	1,820,496.70	3.12
10	000157	中航重机	323,183	1,754,883.69	3.00

7.3.2 期末权证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

本基金报告期内未持有权证。

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

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	000024	万科A	1,854,332.00	2.48
2	000776	广发证券	1,243,798.87	1.67
3	002081	金螳螂	1,136,016.00	1.52
4	002415	海康威视	1,123,270.68	1.50
5	002241	歌尔声学	838,320.80	1.12
6	000878	云南铜业	162,623.00	0.22
7	000895	双汇发展	126,348.00	0.17
8	000758	中色股份	112,482.54	0.15
9	000651	格力电器	95,598.00	0.13
10	000768	中航飞机	93,013.00	0.12
11	000001	平安银行	80,802.00	0.11
12	000002	万科A	76,254.00	0.10
13	000858	五粮液	66,906.00	0.09
14	000157	中联重科	53,574.00	0.07
15	002024	苏宁云商	43,664.00	0.06
16	000423	东阿阿胶	35,588.00	0.05
17	000669	华侨城A	34,448.00	0.05
18	000663	中兴通讯	32,733.00	0.04
19	000338	深桑达A	31,668.00	0.04
20	002038	云南白药	31,389.00	0.04

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额；“成交量”以成交量为准，不考虑相关交易费用。

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

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
----	------	------	----------