

天弘深证成份指数证券投资基金 LOF)

[2012] 第二季度报告

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:二〇一二年七月十九日

重要提示

基金管理人的董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，并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

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7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告财务数据未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至2012年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:天弘深证成份指数(LOF),场内简称天深成。

基金代码:162028

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年8月11日

报告期末基金份额总额:106,395,056.37份

投资目标:本基金通过被动指数化投资, 实现对深证成份指数的有效跟踪,力求基金的净值增长率与深证成份指数的净值增长率相拟合。

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。

本报告财务数据未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至2012年6月30日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期初基金资产净值:18,123.97

本期已实现收益:892,111.44

加权平均基金份额本期利润:0.0083

期末基金份额净值:79,184,388.29

报告期基金份额净值增长率:0.744

注:1.本基金管理人对本期已实现收益扣除非经常性损益后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,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。

2.所列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要低于所列数字。

3.2 基金的业绩表现。

3.2.1 本报告期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 净值增长 净值增长 纯增率(%) 业绩比较基准 业绩比较基准 纯增率(%) ①(%) ②(%) ③(%) ④(%)

过去三个月 1.09% 1.20% 0.94% 1.21% 0.15% -0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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 LOF 基金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 基金经理简介

姓名 职务 在本基金的基金任职期限 证券从业年限

李巍巍 基金经理,天弘基金管理有限公司基金经理,具有基金从业资格,2007年7月加入本公司,历任交易员、行业研究员、风险管理专员,大额资金投资经理,负责基金组合管理。

注:1.上述任职日期为本期基金管理人对境外披露的任职日期。

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。

3.基金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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平等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制度严格执行,根据最新的证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见的要求,公司修订了公平交易制度,制定了公平交易监控制度与报告制度。公平交易制度包括各投资组合、所有投资品种、以及二级市场申购、二级市场交易等所涉及的投资交易活动、授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

4.3.2 异常交易的专项说明

基金管理人对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制度严格执行,严格禁止从自身利益出发不公平交易和利益输送的情况,从而使得基金经理在每一季度内能够获得相对稳定的收益。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金的经营策略和运作分析

本基金在报告期内,从宏观经济、证券市场及行业走势的方面进行分析,同时六月份CPI回落到2.2%,利率水平仍有下降趋势,但市场会逐渐进入,个人认为市场短期仍将继续保持消费类增长结构性行情,但当见到经济数据逐步转好的情况下,周期股或在股票市场上表现的机会。总体上三季末我们看好白酒、医药、地产、工程机械等行业的投资机会,由于深证指数上行业配置较高,因此有望给投资者带来较好收益。

5.6 报告期内持有的债券品种的分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 = -

2 央行票据 = -

3 金融债券 = -

4 其中:政策性金融债 = -

5 企业债券 = -

6 企业短期融资券 = -

7 中期票据 = -

8 可转债 = -

9 合 计 = -

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明细

序号 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 万能债 794,155 8.94

2 五粮液 166,244 6.88

3 中国国电 197,773 5.21

4 中国中车 376,943 4.77

5 中国国航 376,943 4.64

6 中国国电 396,052 4.20

7 中国国电 21,487 3.65

8 中国国电 64,009 3.42

9 中国国电 169,142 2.98

10 中国国电 75,116 2.83

5.6 报告期末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

序号 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国国电 107,426,234.38

2 中国国电 803,622.87

3 中国国电 1,834,800.88

4 合 计 = -

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十名股票投资明细

序号 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国国电 106,395,056.37

2 中国国电 = -

3 中国国电 = -

4 中国国电 = -

5 中国国电 = -

6 中国国电 = -

7 中国国电 = -

8 中国国电 = -

9 中国国电 = -

10 中国国电 = -

5.8 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国国电 1,125,000.00

2 应收证券清算款 = -

3 应收股利 = -

4 应收利息 867.63

5 应收申购款 7,230.65

6 其他应收款 = -

7 待摊费用 = -

8 合 计 1,133,098.28

5.9 报告期内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组合

序号 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国国电 = -

2 中国国电 = -

3 中国国电 = -

4 中国国电 = -

5 中国国电 = -

6 中国国电 = -

7 中国国电 = -

8 中国国电 = -

9 中国国电 = -

10 中国国电 = -

5.10 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国国电 = -

2 中国国电 = -

3 中国国电 = -

4 中国国电 = -

5 中国国电 = -

6 中国国电 = -

7 中国国电 = -

8 中国国电 = -

9 中国国电 = -

10 中国国电 = -

5.11 报告期内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组合

序号 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国国电 = -

2 中国国电 = -

3 中国国电 = -

4 中国国电 = -

5 中国国电 = -

6 中国国电 = -

7 中国国电 = -

8 中国国电 = -

9 中国国电 = -

10 中国国电 = -

5.12 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国国电 = -

2 中国国电 = -

3 中国国电 = -

4 中国国电 = -

5 中国国电 = -

6 中国国电 = -

7 中国国电 = -

8 中国国电 = -

9 中国国电 = -

10 中国国电 = -

5.13 报告期内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组合

序号 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国国电 = -

2 中国国电 = -

3 中国国电 = -

4 中国国电 = -

5 中国国电 = -

6 中国国电 = -

7 中国国电 = -

8 中国国电 = -

9 中国国电 = -

10 中国国电 = -

5.14 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国国电 = -

2 中国国电 = -

3 中国国电 = -

4 中国国电 = -