

天弘周期策略股票型证券投资基金
2010 年年度报告

2010 年 12 月 31 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

报告送出日期：二〇一一年三月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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 2011 年 3 月 23 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。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	1
1.2	目录.....	2
§2	基金简介.....	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	4
2.4	信息披露方式.....	5
2.5	其他相关资料.....	5
§3	主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现.....	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	7
§4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	10
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5	托管人报告.....	11
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6	审计报告.....	12
§7	年度财务报表.....	13
7.1	资产负债表.....	13
7.2	利润表.....	14
7.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	15
7.4	报表附注.....	16
§8	投资组合报告.....	31
8.1	期末基金资产组合情况.....	31
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	31
8.3	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.....	32
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
8.6	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.....	38
8.7	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.....	38
8.8	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.....	38
8.9	投资组合报告附注.....	38

§9	基金份额持有人信息.....	39
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	39
§10	开放式基金份额变动.....	40
§11	重大事件揭示.....	40
11.1	基金份额持有人大会决议.....	40
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	40
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
11.4	基金投资策略的改变.....	40
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	40
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
11.8	其他重大事件.....	42
§12	备查文件目录.....	45
12.1	备查文件目录.....	45
12.2	存放地点.....	45
12.3	查阅方式.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘周期策略股票型证券投资基金
基金简称	天弘周期策略股票
基金主代码	420005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 17 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	367,862,537.04 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过各类资产的策略性配置和有效的风险管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以经济周期理论为指导，运用定性与定量相结合的方法分析经济发展所处的阶段（繁荣、衰退、萧条和复苏），并根据经济发展各个阶段中不同资产类别与不同行业预期表现的分析判断，进行策略性资产配置，在有效控制风险的前提下，精选优质上市公司股票构建投资组合，力求获取较高的超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75% + 中债总全价指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金，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
信息披露负责人	姓名	吕传红
	联系电话	022-83865568
	电子邮箱	lvch@thfund.com.cn
客户服务电话	022-83310988、4007109999	95588
传真	022-83865569	010-66105798
注册地址	天津市河西区马场道 59 号天津国	北京市西城区复兴门内大街

	际经济贸易中心 A 座 16 层	55 号
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 A 座 16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	300203	100140
法定代表人	李琦	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	中国上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	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
分公司	天弘基金管理有限公司北京分公司	北京市西城区金融大街1号金亚光大厦A座15层
	天弘基金管理有限公司上海分公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 8 楼 B 单元
	天弘基金管理有限公司广州分公司	广州市天河区珠江新城华夏路10号富力中心写字楼第 10 层 08单元

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	2010 年	2009 年 12 月 17 日(基金合同生效日) — 2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	59,923,005.15	4,788,162.59
本期利润	96,583,656.68	4,934,148.66
加权平均基金份额本期利润	0.1921	0.0071
本期加权平均净值利润率	18.83%	0.70%
本期基金份额净值增长率	17.54%	0.70%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	52,314,941.98	4,788,324.28

期末可供分配基金份额利润	0.1422	0.0069
期末基金资产净值	420,177,479.02	703,899,217.92
期末基金份额净值	1.142	1.007
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	18.36%	0.70%

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，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负债表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率的比较

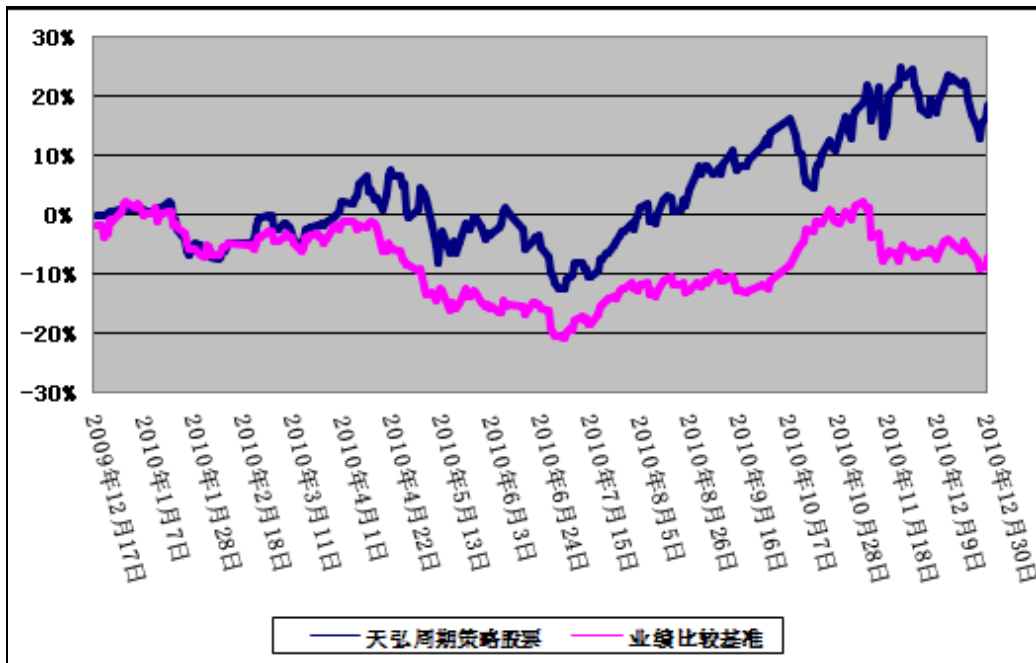
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.10%	1.96%	4.28%	1.33%	-0.18%	0.63%
过去六个月	31.81%	1.63%	15.62%	1.16%	16.19%	0.47%
过去一年	17.54%	1.60%	-9.21%	1.19%	26.75%	0.41%
自基金合同生效起至今	18.36%	1.57%	-7.32%	1.19%	25.68%	0.38%

注：天弘周期策略股票型证券投资基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*75%+中债总全价指数收益率*25%。

沪深 300 指数和中债总全价指数分别反映了中国证券市场和债券市场的整体运行状况，具有可操作性和投资性。本基金股票投资比例范围是 60%-95%，债券和短期金融工具的投资比例范围是 5%-40%，分别参考上述投资比例范围的中值，确定本基金业绩比较基准中沪深 300 指数占 75%，中债总全价指数占 25%，并且比较基准每日按照 75%和 25%对沪深 300 指数和中债总全价指数进行再平衡。

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及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

天弘周期策略股票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对比图
(2009年12月17日至2010年12月31日)

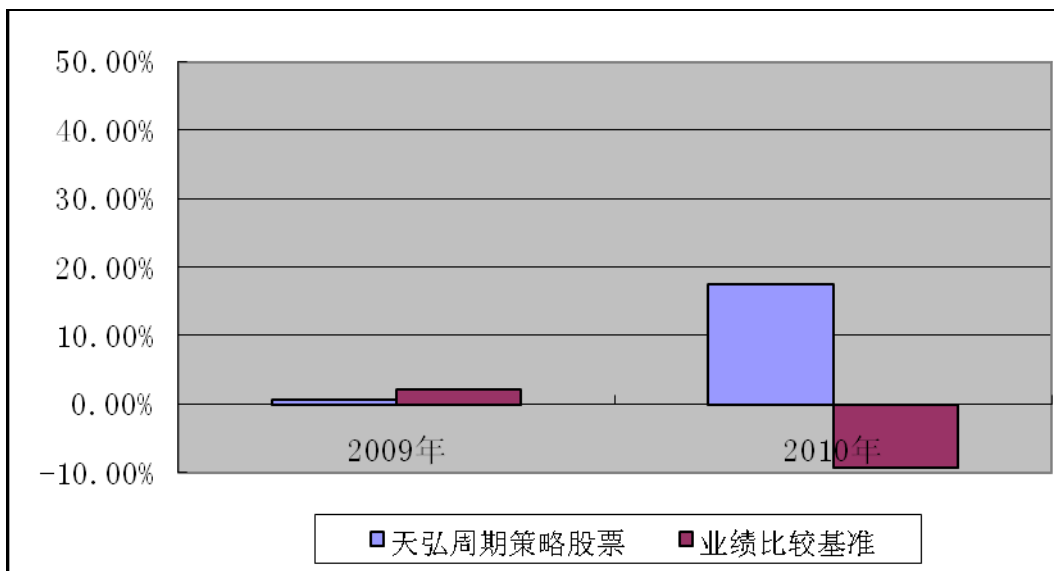


注：1、本基金合同于2009年12月17日生效。

2、基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

本基金的建仓期为2009年12月17日至2010年6月16日，建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2009年12月17日生效。基金合同生效当年2009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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2010 年	0.420	11,141,168.14	4,136,093.01	15,277,261.15	无
2009 年	-	-	-	-	无
合计	0.420	11,141,168.14	4,136,093.01	15,277,261.15	无

§ 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。注册资本金为 1 亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州分别设有分公司。公司股东为天津信托有限责任公司（持股比例 48%）、兵器财务有限责任公司（持股比例 26%）、内蒙古君正能源化工股份有限公司（持股比例 26%）。本基金管理人目前管理六只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘周期策略股票型证券投资基金、天弘周期策略股票型证券投资基金、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。

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
		任职日期	离任日期		
吕宜振	本基金基金经理；天弘精选混合型证券投资基金基金经理；本公司投资总监。	2010年4月	—	9年	男，工学博士。历任易方达基金管理有限公司研究主管；信诚基金管理有限公司研究总监；信诚精粹成长股票型证券投资基金基金经理。2008年加盟本公司，历任天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理。
姚锦	本基金基金经理；天弘永利债券型证券投资基金基金经理；本公司研究部主管。	2009年12月	—	6年	女，管理学博士，2004年加盟本公司。历任本公司行业研究员、高级研究员、研究部主管兼金融工程部主管、金融工程部主管。

注：1、上述任职日期、离任日期均为本基金管理人对外披露的任免日期。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、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。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内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

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原则的严格执行。根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司制定并执行了公平交易管理办法。公平交易管理办法的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。

公平交易的执行情况包括：公平对待不同投资组合，严禁进行以各投资组合之间利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；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资讯；实行集中交易制度和公平的交易分配制度；加强对投资交易行为的监察稽核力度等。

本报告期内，基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下没有与天弘周期策略股票型证券投资基金投资风格相似的基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生法规禁止的同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对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

经历了 2009 年 4 万亿投资的刺激之后，2010 年从政策到市场都进入重新思考之中。受制于宽松政策的调整，以及对于经济内生增长能力的疑虑，市场一度陷入对二次探底的担忧之中。由于缺乏对于增长的明确预期，因此 2010 年全年市场呈现调整态势，投资机会呈现结构性分化和个股分化。针对政策和经济的不明朗，本基金在 2010 年确定的投资策略为精选个股，寻找确定性增长。本基金在全年始终坚持把握投资标的基本面情况，对估值进行动态审视，并据以进行调整。另外，本基金还遵循消费、调结构、新技术等思路，对相应板块进行了深入的分析，根据地产等周期性行业的基本面以及政策变化情况进行配置，都取得了较好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.142 元。本报告期本基金份额净值增长率

17.54%，同期业绩比较基准增长率-9.21%。高于基准 26.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年与前一年最大的一个区别在于，经济增长的趋势在逐步形成。虽然市场也会担心经济的内生性增长动力，以及政策对于总需求的影响，但政策紧缩、通胀高企、流动性收紧等只是影响经济增长的一些扰动因素，并不足以改变增长的路径。伴随市场对于经济增长趋势的逐步确认，企业业绩伴随资本回报率的上升而提高，股票市场的估值水平也有望实现提升。但必须注意的是，短期制约市场的主要因素，即通胀、政策和增长之间仍旧会比较纠结，这些因素的不同组合情形将是影响市场波动的主要因素。

在 2011 年，本基金的投资重点是受益经济增长的行业，对受政策压制的行业，如地产等将采取较为谨慎的态度，对于受政策影响较大的行业，将根据政策变化的情况进行及时调整。另外，本基金仍旧会从精选个股的思路出发，寻找具有较好成长性的个股。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人监察稽核一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司经理层。

同时，进一步完善公司内控机制和体系，不断推动和督促公司相关的内控制度、规章和业务流程的建立、健全。全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。

本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、在研究环节，关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易风险管理环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会决定适时增加或优化交易系统风控指标，通过投资交易系统来控制投资风险；对每日的交易行为和交易结果进行监控并做好记录，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒形式与内容的合法性检查，保障投资环节的合规运作；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员 MSN、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，建立投资管理人员直系亲属账户及股票交易申报制度，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、非公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及基金代销、定投、费率优惠等业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规；

5、基金运营环节，加强对注册登记、基金会计、基金清算及基金估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整与及时。

本基金自成立以来，运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。我们将继续加强监察稽核工作，不断完善内部控制和风险管理，保障基金合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保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，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、基金运营部负责人及监察稽核部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关工作经验、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《天弘周期策略股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金进行了第一次分红。以 2010 年 12 月 14 日已实现的可分配收益 55,556,343.59 元为基准计算，2010 年 12 月 24 日向本基金的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.42 元。本次分红符合本基金基金合同中利润分配的相关约定。

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2010 年，本基金托管人在对天弘周期策略股票型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规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010 年，天弘周期策略股票型证券投资基金的管理人——天弘基金管理有限公司在天弘周期策略股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，天弘周期策略股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 15,277,261.15 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘周期策略股票型证券投资基金 2010 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2011)第 20567 号

天弘周期策略股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的天弘周期策略股票型证券投资基金(以下简称“天弘周期策略基金”)的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日和 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度和 2009 年 12 月 17 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是天弘周期策略基金的基金管理人天弘基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

二、 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了天弘周期策略基金 2010 年 12 月 31 日和 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度和 2009 年 12 月 17 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师 薛 竞

2011 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘周期策略股票型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	47,800,458.88	485,708,013.08
结算备付金		1,343,247.11	-
存出保证金		1,834,019.25	-
交易性金融资产	7.4.7.2	373,252,459.85	42,141,326.69
其中：股票投资		373,252,459.85	42,141,326.69
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	186,000,479.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	9,300.77	100,087.04
应收股利		-	-
应收申购款		79,625.71	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		424,319,111.57	713,949,905.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,635,093.51	9,351,180.88
应付赎回款		139,203.84	-
应付管理人报酬		515,527.09	403,273.54

应付托管费		85,921.20	67,212.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,201,111.29	214,415.84
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	564,775.62	14,605.35
负债合计		4,141,632.55	10,050,687.89
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	367,862,537.04	698,964,890.67
未分配利润	7.4.7.10	52,314,941.98	4,934,327.25
所有者权益合计		420,177,479.02	703,899,217.92
负债和所有者权益总计		424,319,111.57	713,949,905.81

注：1、报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.142 元，基金份额总额 367,862,537.04 份。

2、比较财务报表的实际编制期间为 2009 年 12 月 17 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：天弘周期策略股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 12 月 17 日(基 金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
一、收入		115,977,453.65	5,791,655.76
1. 利息收入		905,225.16	270,167.66
其中：存款利息收入	7.4.7.11	791,774.13	138,303.43
债券利息收入		262.28	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		113,188.75	131,864.23
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		77,265,940.06	5,375,502.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	74,982,279.49	5,375,502.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	178,341.72	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,105,318.85	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	36,660,651.53	145,986.07
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	1,145,636.90	-

减：二、费用		19,393,796.97	857,507.10
1. 管理人报酬		7,713,585.73	403,273.54
2. 托管费		1,285,597.75	67,212.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	10,015,884.08	372,155.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	378,729.41	14,865.85
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		96,583,656.68	4,934,148.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		96,583,656.68	4,934,148.66

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：天弘周期策略股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	698,964,890.67	4,934,327.25	703,899,217.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	96,583,656.68	96,583,656.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-331,102,353.63	-33,925,780.80	-365,028,134.43
其中：1. 基金申购款	528,319,021.47	27,239,492.89	555,558,514.36
2. 基金赎回款	-859,421,375.10	-61,165,273.69	-920,586,648.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-15,277,261.15	-15,277,261.15
五、期末所有者权益(基金净值)	367,862,537.04	52,314,941.98	420,177,479.02
项目	上年度可比期间 2009 年 12 月 17 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	698,939,377.56	-	698,939,377.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,934,148.66	4,934,148.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	25,513.11	178.59	25,691.70
其中：1. 基金申购款	25,513.11	178.59	25,691.70

2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	698,964,890.67	4,934,327.25	703,899,217.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

胡 敏	胡 敏	田 中 甲
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘周期策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 1065 号《关于核准天弘周期策略股票型证券投资基金募集的批复》核准,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘周期策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 698,898,121.78 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 284 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘周期策略股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 12 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 698,939,377.56 份基金份额,其中认购资金利息折合 41,255.78 份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《天弘周期策略股票型证券投资基金基金合同》和最新公告的《天弘周期策略股票型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例为 60-95%;除股票资产以外的其他资产投资占基金资产的比例为 5-40%,其中,权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×75% + 中债总全价指数收益率×25%。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于 2011 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘周期策略股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年度和 2009 年 12 月 17 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2010 年 12 月 31 日和 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度和 2009 年 12 月 17 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间

的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2009 年 12 月 17 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

- 1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

- 2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

- 3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具

有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 本基金该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

(1) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期不存在会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期不存在会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期不存在差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	47,800,458.88	485,708,013.08
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	47,800,458.88	485,708,013.08

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2010 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		336,445,822.25	373,252,459.85	36,806,637.60
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		336,445,822.25	373,252,459.85	36,806,637.60
项目		上年度末 2009 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		41,995,340.62	42,141,326.69	145,986.07
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		41,995,340.62	42,141,326.69	145,986.07

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日

	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	186,000,479.00	-
合计	186,000,479.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	8,783.66	82,388.28
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	517.11	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	17,698.76
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	9,300.77	100,087.04

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,201,111.29	213,936.84
银行间市场应付交易费用	-	479.00
合计	1,201,111.29	214,415.84

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

应付券商交易单元保证金	500,000.00	-
应付赎回费	275.62	-
预提费用	64,500.00	14,605.35
合计	564,775.62	14,605.35

7.4.7.9. 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	698,964,890.67	698,964,890.67
本期申购	528,319,021.47	528,319,021.47
本期赎回(以“-”号填列)	-859,421,375.10	-859,421,375.10
本期末	367,862,537.04	367,862,537.04

注：1. 本基金于 2009 年 11 月 16 日起公开发售，共募集有效净认购资金 698,898,121.78 元。根据《天弘周期策略股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 41,255.78 元，折算为 41,255.78 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《天弘周期策略股票型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2009 年 12 月 17 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 27 日止期间暂不向投资人开放基金交易，自 2009 年 12 月 28 日起开始办理申购和赎回业务。

3. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,788,324.28	146,002.97	4,934,327.25
本期利润	59,923,005.15	36,660,651.53	96,583,656.68
本期基金份额交易产生的变动数	4,359,278.47	-38,285,059.27	-33,925,780.80
其中：基金申购款	8,275,026.11	18,964,466.78	27,239,492.89
基金赎回款	-3,915,747.64	-57,249,526.05	-61,165,273.69
本期已分配利润	-15,277,261.15	-	-15,277,261.15
本期末	53,793,346.75	-1,478,404.77	52,314,941.98

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年12月17日(基金合同生 效日)至2009年12月31日
活期存款利息收入	750,226.70	138,303.43
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	41,547.43	-
其他	-	-
合计	791,774.13	138,303.43

7.4.7.12 股票投资收益
7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年12月17日(基金合同 生效日)至2009年12月31日
卖出股票成交总额	3,231,734,146.46	110,814,704.94
减：卖出股票成本总额	3,156,751,866.97	105,439,202.91
买卖股票差价收入	74,982,279.49	5,375,502.03

7.4.7.13 债券投资收益

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年12月17日(基金合同 生效日)至2009年12月31日
卖出债券及债券到期兑付成交金额	732,604.00	-
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	554,000.00	-
减：应收利息总额	262.28	-
债券投资收益	178,341.72	-

7.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本期及上年度可比期间未取得衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年12月17日(基金合同 生效日)至2009年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,105,318.85	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,105,318.85	-

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年12月17日(基金合同 生效日)至2009年12月31日
1. 交易性金融资产	36,660,651.53	145,986.07
——股票投资	36,660,651.53	145,986.07
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-

3. 其他	-	-
合计	36,660,651.53	145,986.07

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年12月17日(基金合同 生效日)至2009年12月31日
基金赎回费收入	1,084,507.82	-
基金转出费收入	61,129.08	-
认购款利息收入	-	-
合计	1,145,636.90	-

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转出费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年12月17日(基金合同 生效日)至2009年12月31日
交易所市场交易费用	10,015,884.08	372,155.43
银行间市场交易费用	-	-
合计	10,015,884.08	372,155.43

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年12月17日(基金合同 生效日)至2009年12月31日
审计费用	57,236.85	2,763.15
信息披露费	288,157.80	11,842.20
债券托管账户维护费	18,000.00	-
银行划款手续费	14,434.76	260.50
其他	900.00	-
合计	378,729.41	14,865.85

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
兵器财务有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年12月17日(基金 合同生效日)至2009年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,713,585.73	403,273.54
其中：支付销售机构的客户维护费	1,489,712.12	103,590.39

注：支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010 年12月31日	上年度可比期间 2009年12月17日(基金合同 生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,285,597.75	67,212.28

注：1、支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金份额。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

关联方名称	本期末 2010年12月31日		上年度末 2009年12月31日	
	持有的	持有的基金份额占	持有的	持有的基金份额

	基金份额	基金总份额的比例	基金份额	占基金总份额的比例
兵器财务有限责任公司	-	-	9,999,000.00	1.43%

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日		上年度可比期间 2009年12月17日(基金合同生效日)至 2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	47,800,458.88	750,226.70	485,708,013.08	138,303.43

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券业务。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2010-12-24	2010-12-24	0.420	11,141,168.14	4,136,093.01	15,277,261.15	
合计	-	-	0.420	11,141,168.14	4,136,093.01	15,277,261.15	

7.4.12 期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末(2010年12月31日)止本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300113	顺网科技	2010-12-13	2011-01-31	正在筹划重大资产重组事项	69.40	75.98	80,000	5,615,988.66	5,552,000.00	

注：本基金截至2010年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止,本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止,本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为主动投资的股票型基金,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。本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳健增值,为投资人创造超额收益。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以督查委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理,从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立督查委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险管理委员会,主要负责评估风险、提出控制政策建议;金融工程部专门负责基金投资绩效、风险的计量和控制;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责,并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。于 2010 年 12 月 31 日,本基金未持有信用类债券(2009 年 12 月 31 日:同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、个股持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，能以合理的价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款及结算备付金，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	47,800,458.88	-	-	-	47,800,458.88
结算备付金	1,343,247.11	-	-	-	1,343,247.11
存出保证金	-	-	-	1,834,019.25	1,834,019.25
交易性金融资产	-	-	-	373,252,459.85	373,252,459.85
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,300.77	9,300.77
应收申购款	-	-	-	79,625.71	79,625.71
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	49,143,705.99	-	-	375,175,405.58	424,319,111.57
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,635,093.51	1,635,093.51
应付赎回款	-	-	-	139,203.84	139,203.84
应付管理人报酬	-	-	-	515,527.09	515,527.09
应付托管费	-	-	-	85,921.20	85,921.20
应付交易费用	-	-	-	1,201,111.29	1,201,111.29

其他负债	-	-	-	564,775.62	564,775.62
负债总计	-	-	-	4,141,632.55	4,141,632.55
利率敏感度缺口	49,143,705.99	-	-	371,033,773.03	420,177,479.02
上年度末 2009 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	485,708,013.08	-	-	-	485,708,013.08
结算备付金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	42,141,326.69	42,141,326.69
买入返售金融资产	186,000,479.00	-	-	-	186,000,479.00
应收利息	-	-	-	100,087.04	100,087.04
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	671,708,492.08	-	-	42,241,413.73	713,949,905.81
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,351,180.88	9,351,180.88
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	403,273.54	403,273.54
应付托管费	-	-	-	67,212.28	67,212.28
应付交易费用	-	-	-	214,415.84	214,415.84
其他负债	-	-	-	14,605.35	14,605.35
负债总计	-	-	-	10,050,687.89	10,050,687.89
利率敏感度缺口	671,708,492.08	-	-	32,190,725.84	703,899,217.92

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

至 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2009 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2009 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 60%—95%，除股票资产以外的其他资产投资占基金资产的比例为 5%

-40%，其中，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	373,252,459.85	88.83	42,141,326.69	5.99
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	373,252,459.85	88.83	42,141,326.69	5.99

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币万元)	
		本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 1,744	注
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	下降约 1,744	注

注：由于本基金于 2009 年 12 月 17 日成立，截至 2009 年 12 月 31 日运营不满一年，因而无足够历史数据分析上年可比期间其他价格风险敏感性。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 367,700,459.85 元，属于第二层级的余额为 5,552,000.00 元，无属于第三层级的余额(2009 年

12 月 31 日：第一层级 42,141,326.69 元，无第二层级和第三层级）。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级（2009 年度：无）。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	373,252,459.85	87.97
	其中：股票	373,252,459.85	87.97
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
	其中：权证	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	49,143,705.99	11.58
6	其他各项资产	1,922,945.73	0.45
7	合计	424,319,111.57	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	24,389,384.50	5.80
B	采掘业	-	-
C	制造业	249,188,650.56	59.31
C0	食品、饮料	18,299,500.00	4.36
C1	纺织、服装、皮毛	10,932,000.00	2.60
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	23,528,034.12	5.60
C5	电子	37,079,640.00	8.82
C6	金属、非金属	46,979,660.63	11.18
C7	机械、设备、仪表	33,715,123.30	8.02
C8	医药、生物制品	78,654,692.51	18.72

C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	43,099,232.98	10.26
H	批发和零售贸易	7,991,347.32	1.90
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	35,495,565.77	8.45
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	13,088,278.72	3.11
	合计	373,252,459.85	88.83

8.3 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

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	002410	广联达	339,981	24,138,651.00	5.74
2	000629	*ST 钒钛	1,300,000	15,002,000.00	3.57
3	002321	华英农业	577,879	14,620,338.70	3.48
4	600535	天士力	349,818	14,258,581.68	3.39
5	002422	科伦药业	90,000	14,176,800.00	3.37
6	300072	三聚环保	300,000	13,500,000.00	3.21
7	600276	恒瑞医药	199,812	11,900,802.72	2.83
8	002415	海康威视	119,950	11,311,285.00	2.69
9	600812	华北制药	709,801	11,150,973.71	2.65
10	002293	罗莱家纺	150,000	10,932,000.00	2.60
11	600801	华新水泥	350,000	10,535,000.00	2.51
12	600809	山西汾酒	150,000	10,279,500.00	2.45
13	000423	东阿阿胶	200,000	10,220,000.00	2.43
14	600141	兴发集团	499,902	10,028,034.12	2.39
15	002106	莱宝高科	150,000	9,937,500.00	2.37
16	000789	江西水泥	800,000	9,904,000.00	2.36
17	000998	隆平高科	299,940	9,769,045.80	2.33
18	002138	顺络电子	349,949	9,693,587.30	2.31
19	600823	世茂股份	699,859	9,455,095.09	2.25
20	000009	中国宝安	500,000	8,385,000.00	2.00
21	002146	荣盛发展	600,000	8,154,000.00	1.94
22	000596	古井贡酒	100,000	8,020,000.00	1.91
23	600778	友好集团	599,951	7,991,347.32	1.90
24	002004	华邦制药	150,000	7,911,000.00	1.88

25	002111	威海广泰	299,919	7,557,958.80	1.80
26	000401	冀东水泥	299,901	7,086,660.63	1.69
27	002006	精功科技	149,970	6,756,148.50	1.61
28	600376	首开股份	399,932	6,738,854.20	1.60
29	002158	汉钟精机	174,406	6,278,616.00	1.49
30	002244	滨江集团	549,966	6,203,616.48	1.48
31	002484	江海股份	199,911	6,137,267.70	1.46
32	300113	顺网科技	80,000	5,552,000.00	1.32
33	300142	沃森生物	39,910	5,316,012.00	1.27
34	002232	启明信息	229,952	5,286,596.48	1.26
35	600383	金地集团	800,000	4,944,000.00	1.18
36	600811	东方集团	599,908	4,703,278.72	1.12
37	600585	海螺水泥	150,000	4,452,000.00	1.06
38	300124	汇川技术	30,000	4,196,400.00	1.00
39	002230	科大讯飞	52,796	4,170,884.00	0.99
40	002153	石基信息	69,931	3,951,101.50	0.94
41	002168	深圳惠程	100,000	3,871,000.00	0.92
42	002213	特尔佳	200,000	3,430,000.00	0.82
43	002349	精华制药	49,908	1,886,522.40	0.45
44	300006	莱美药业	50,000	1,834,000.00	0.44
45	002283	天润曲轴	50,000	1,625,000.00	0.39

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600031	三一重工	47,006,783.73	6.68
2	000540	中天城投	44,348,648.09	6.30
3	002106	莱宝高科	41,979,698.11	5.96
4	000998	隆平高科	40,037,657.46	5.69
5	600118	中国卫星	35,467,489.82	5.04
6	002091	江苏国泰	34,618,808.83	4.92
7	002051	中工国际	30,114,555.52	4.28
8	600563	法拉电子	29,683,558.98	4.22
9	600037	歌华有线	28,785,679.02	4.09
10	600750	江中药业	28,137,988.50	4.00
11	002041	登海种业	27,528,690.81	3.91
12	002244	滨江集团	25,827,163.06	3.67
13	000969	安泰科技	25,805,996.43	3.67

14	600303	曙光股份	25,749,298.30	3.66
15	000826	桑德环境	25,631,776.87	3.64
16	600376	首开股份	25,109,526.30	3.57
17	601288	农业银行	24,836,854.00	3.53
18	600221	海南航空	24,726,427.96	3.51
19	600502	安徽水利	24,659,500.47	3.50
20	000425	徐工机械	24,315,291.41	3.45
21	002138	顺络电子	24,225,895.81	3.44
22	601111	中国国航	24,177,712.00	3.43
23	000999	华润三九	23,997,158.69	3.41
24	000960	锡业股份	23,571,046.50	3.35
25	600208	新潮中宝	22,849,683.82	3.25
26	002410	广联达	22,630,696.27	3.22
27	000848	承德露露	22,235,824.54	3.16
28	000596	古井贡酒	22,197,215.58	3.15
29	600584	长电科技	21,895,716.63	3.11
30	600660	福耀玻璃	21,661,287.88	3.08
31	600383	金地集团	21,531,779.86	3.06
32	600690	青岛海尔	21,435,618.44	3.05
33	000423	东阿阿胶	20,956,905.96	2.98
34	000650	仁和药业	20,924,965.80	2.97
35	600754	锦江股份	20,922,714.73	2.97
36	600664	哈药股份	20,500,774.01	2.91
37	000400	许继电气	20,405,113.24	2.90
38	002001	新 和 成	20,323,884.56	2.89
39	300072	三聚环保	20,218,770.66	2.87
40	000718	苏宁环球	20,198,437.41	2.87
41	000963	华东医药	19,995,076.13	2.84
42	600141	兴发集团	19,830,032.66	2.82
43	600422	昆明制药	19,050,459.86	2.71
44	000811	烟台冰轮	18,937,657.35	2.69
45	600038	哈飞股份	18,766,876.38	2.67
46	002236	大华股份	18,546,155.85	2.63
47	600183	生益科技	18,414,071.38	2.62
48	000519	江南红箭	18,291,560.31	2.60
49	002273	水晶光电	17,894,027.68	2.54
50	002022	科华生物	17,846,948.18	2.54
51	600111	包钢稀土	17,534,692.79	2.49
52	600053	中江地产	17,512,066.40	2.49
53	600054	黄山旅游	17,394,623.60	2.47
54	000972	新 中 基	17,384,282.50	2.47

55	600557	康缘药业	17,177,145.29	2.44
56	300030	阳普医疗	17,091,967.24	2.43
57	000338	潍柴动力	17,001,235.53	2.42
58	600197	伊力特	16,960,748.21	2.41
59	600718	东软集团	16,941,385.61	2.41
60	600360	华微电子	16,884,147.68	2.40
61	600707	彩虹股份	16,287,341.69	2.31
62	002065	东华软件	16,271,575.49	2.31
63	600580	卧龙电气	16,161,538.46	2.30
64	002321	华英农业	15,979,739.80	2.27
65	002315	焦点科技	15,952,468.42	2.27
66	600486	扬农化工	15,893,442.74	2.26
67	002155	辰州矿业	15,866,634.24	2.25
68	000713	丰乐种业	15,716,347.90	2.23
69	002254	烟台氨纶	15,704,817.75	2.23
70	600467	好当家	15,621,439.93	2.22
71	600498	烽火通信	15,495,427.87	2.20
72	000528	柳工	15,495,000.75	2.20
73	002146	荣盛发展	15,436,481.28	2.19
74	002293	罗莱家纺	15,320,543.13	2.18
75	002344	海宁皮城	15,310,873.78	2.18
76	002422	科伦药业	15,157,413.76	2.15
77	600869	三普药业	15,038,079.85	2.14
78	600366	宁波韵升	14,985,067.77	2.13
79	600309	烟台万华	14,983,696.45	2.13
80	000937	冀中能源	14,911,905.78	2.12
81	002004	华邦制药	14,910,705.06	2.12
82	000629	*ST 钒钛	14,711,388.85	2.09
83	600352	浙江龙盛	14,662,393.86	2.08
84	600067	冠城大通	14,579,321.50	2.07
85	600316	洪都航空	14,480,021.09	2.06
86	300113	顺网科技	14,400,377.71	2.05
87	002038	双鹭药业	14,388,750.33	2.04
88	000970	中科三环	14,362,639.40	2.04
89	000415	*ST 汇通	14,307,613.13	2.03
90	600535	天士力	14,226,470.19	2.02
91	002277	友阿股份	14,210,885.95	2.02

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002051	中工国际	48,089,485.80	6.83
2	600031	三一重工	46,028,635.14	6.54
3	000540	中天城投	44,534,276.11	6.33
4	600118	中国卫星	41,854,848.19	5.95
5	002106	莱宝高科	41,213,694.13	5.86
6	600563	法拉电子	36,597,098.36	5.20
7	600750	江中药业	35,523,044.74	5.05
8	002091	江苏国泰	33,488,905.38	4.76
9	002041	登海种业	29,586,415.78	4.20
10	000998	隆平高科	29,191,948.06	4.15
11	000596	古井贡酒	28,996,753.21	4.12
12	600037	歌华有线	28,654,504.46	4.07
13	000848	承德露露	28,540,457.85	4.05
14	601111	中国国航	27,120,429.39	3.85
15	600303	曙光股份	26,899,172.35	3.82
16	000826	桑德环境	26,455,599.02	3.76
17	600502	安徽水利	25,677,726.60	3.65
18	601288	农业银行	24,617,499.00	3.50
19	000425	徐工机械	24,514,661.21	3.48
20	000650	仁和药业	24,177,713.54	3.43
21	600208	新湖中宝	23,152,662.72	3.29
22	000969	安泰科技	23,070,650.69	3.28
23	600584	长电科技	22,819,081.61	3.24
24	600221	海南航空	22,390,224.81	3.18
25	002244	滨江集团	22,388,776.29	3.18
26	600690	青岛海尔	21,552,325.82	3.06
27	002236	大华股份	21,550,054.26	3.06
28	000718	苏宁环球	21,503,574.07	3.05
29	000999	华润三九	21,471,414.20	3.05
30	600660	福耀玻璃	21,436,383.65	3.05
31	000960	锡业股份	20,057,288.76	2.85
32	002344	海宁皮城	19,970,874.37	2.84
33	000963	华东医药	19,728,232.91	2.80
34	600754	锦江股份	19,635,075.45	2.79
35	600111	包钢稀土	19,522,590.39	2.77
36	000400	许继电气	19,361,194.50	2.75
37	000811	烟台冰轮	19,023,899.22	2.70
38	600376	首开股份	18,968,911.37	2.69

39	002001	新 和 成	18,891,103.41	2.68
40	600038	哈飞股份	18,840,118.43	2.68
41	600664	哈药股份	18,756,424.73	2.66
42	600422	昆明制药	18,477,868.02	2.63
43	000519	江南红箭	18,143,879.57	2.58
44	600707	彩虹股份	17,991,555.91	2.56
45	002022	科华生物	17,855,042.66	2.54
46	002273	水晶光电	17,842,692.65	2.53
47	600366	宁波韵升	17,292,671.64	2.46
48	000338	潍柴动力	17,154,617.32	2.44
49	600383	金地集团	17,087,158.57	2.43
50	002065	东华软件	16,979,029.92	2.41
51	002254	烟台氨纶	16,869,883.77	2.40
52	600183	生益科技	16,839,123.49	2.39
53	002315	焦点科技	16,827,883.98	2.39
54	600053	中江地产	16,759,364.69	2.38
55	000970	中科三环	16,694,015.91	2.37
56	002375	亚厦股份	16,674,890.90	2.37
57	600486	扬农化工	16,672,733.77	2.37
58	600054	黄山旅游	16,586,033.22	2.36
59	600197	伊力特	16,373,100.56	2.33
60	002277	友阿股份	16,295,351.88	2.32
61	002069	獐子岛	16,225,825.11	2.31
62	600557	康缘药业	16,030,487.23	2.28
63	000528	柳 工	15,923,775.87	2.26
64	600718	东软集团	15,901,766.85	2.26
65	600309	烟台万华	15,326,312.88	2.18
66	600461	洪城水业	14,986,377.05	2.13
67	600352	浙江龙盛	14,984,811.73	2.13
68	002138	顺络电子	14,921,082.45	2.12
69	002038	双鹭药业	14,754,541.61	2.10
70	002329	皇氏乳业	14,739,669.63	2.09
71	000972	新 中 基	14,675,486.45	2.08
72	000157	中联重科	14,607,681.99	2.08
73	000415	*ST 汇通	14,572,745.79	2.07
74	600360	华微电子	14,476,897.11	2.06
75	300030	阳普医疗	14,389,370.50	2.04
76	002437	誉衡药业	14,365,083.90	2.04
77	600869	三普药业	14,216,958.13	2.02
78	600467	好当家	14,188,645.06	2.02
79	000713	丰乐种业	14,055,565.87	2.00

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,451,202,348.60
卖出股票收入（成交）总额	3,231,734,146.46

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	合计	-	-

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.9.2 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。

8.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,834,019.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,300.77
5	应收申购款	79,625.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	合计	1,922,945.73

8.9.4 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。

8.9.5 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情况。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
3284	112,016.61	297,869,606.65	80.97%	69,992,930.39	19.03%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额 级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金		117,300.00	0.03%
	合计	117,300.00	0.03%

§ 10 开放式基金份额变动

份额单位：份

基金合同生效日（2009 年 12 月 17 日）基金份额总额	698,939,377.56
报告期期初基金份额总额	698,964,890.67
报告期期间基金总申购份额	528,319,021.47
减：报告期期间基金总赎回份额	859,421,375.10
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	367,862,537.04

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应向普华永道中天会计师事务所有限公司支付服务费 6 万元整。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所有限公司已为天弘周期策略股票型证券投资基金提供审计服务 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券股份有限公司	2	2,719,048,952.27	40.70%	2,260,124.94	40.78%	无
广州证券有限责任公司	2	854,264,780.99	12.79%	703,879.30	12.70%	无
安信证券股份有限公司	1	704,584,638.07	10.55%	572,479.90	10.33%	无
申银万国证券股份有限公司	2	619,235,027.34	9.27%	503,132.53	9.08%	无
英大证券有限责任公司	2	435,656,852.32	6.52%	370,306.65	6.68%	无
中信证券股份有限公司	1	422,118,071.86	6.32%	358,799.28	6.47%	无
东兴证券股份有限公司	1	327,777,573.86	4.91%	278,611.12	5.03%	无
平安证券有限责任公司	1	179,548,033.52	2.69%	145,884.38	2.63%	无
招商证券股份有限公司	1	114,190,758.41	1.71%	92,781.17	1.67%	无
北京高华证券有限责任公司	1	89,830,606.16	1.34%	72,987.59	1.32%	无
齐鲁证券有限公司	1	88,893,885.77	1.33%	75,558.93	1.36%	无
中国国际金融有限公司	1	54,090,692.02	0.81%	45,976.40	0.83%	无
光大证券股份有限公司	1	30,826,615.15	0.46%	26,202.50	0.47%	无
华泰联合证券有限责任公司	1	27,703,930.82	0.41%	23,548.02	0.42%	无
长江证券股份有限公司	1	12,177,376.36	0.18%	10,350.77	0.19%	无
山西证券有限责任公司	1	1,337,930.08	0.02%	1,137.27	0.02%	无
券商名称	交易单元数量	债券回购		备注		
		回购交易量	占回购交易总量比例			
渤海证券股份有限公司	2	200,000,000.00	39.22%	无		
广州证券有限责任公司	2	160,000,000.00	31.37%	无		
东兴证券股份有限公司	1	150,000,000.00	29.41%	无		

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、报告期内新租用证券公司交易单元情况

序号	证券公司名称	所属市场	数量
1	东兴证券股份有限公司	上海	1个
2	广州证券有限责任公司	上海、深圳	各1个
3	英大证券有限责任公司	上海、深圳	各1个

4	安信证券股份有限公司	深圳	1 个
5	北京高华证券有限责任公司	深圳	1 个
6	兴业证券股份有限公司	上海	1 个
7	西藏同信证券有限责任公司	上海、深圳	各 1 个
8	华宝证券有限责任公司	上海	1 个
9	申银万国证券股份有限公司	深圳	1 个
10	光大证券股份有限公司	深圳	1 个

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于北京分公司地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 4 日
2	关于旗下基金开通中信建投证券定期定额投资及定投申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 4 日
3	关于天弘周期策略股票型基金打开日常赎回及基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 6 日
4	关于旗下基金开通招商银行网上交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 6 日
5	关于旗下基金参加中国银河证券定投及申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 14 日
6	天弘基金管理有限公司关于公司名称变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 19 日
7	关于旗下基金在部分代销机构开通定投及申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 19 日
8	关于旗下基金参加中国邮储银行网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 22 日
9	天弘基金管理有限公司关于上海分公司成立的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 3 月 10 日
10	关于旗下基金参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 4 月 1 日
11	关于天弘周期策略股票型基金在中国邮政储蓄银行开通定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 4 月 1 日
12	关于增加广州证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 4 月 8 日
13	关于旗下基金在广州证券开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 4 月 8 日
14	关于增加信达证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 4 月 16 日
15	关于在信达证券开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 4 月 16 日

16	关于旗下基金参加广州证券网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 4 月 16 日
17	天弘基金管理有限公司关于基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 4 月 16 日
18	天弘周期策略股票型证券投资基金 2010 年 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 4 月 21 日
19	关于增加英大证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 5 月 10 日
20	关于在英大证券开通旗下基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 5 月 10 日
21	关于再次提请旗下基金投资者及时更新身份证件或身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 5 月 11 日
22	关于在华安证券开通旗下基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 5 月 12 日
23	关于增加华安证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 5 月 12 日
24	关于华安证券开通旗下基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 5 月 12 日
25	关于在广州证券开通旗下基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 5 月 13 日
26	关于在华夏银行开通旗下基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 5 月 20 日
27	关于增加国联证券、天相投顾为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 5 月 28 日
28	关于旗下基金在国联证券、天相投顾开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 5 月 28 日
29	关于旗下基金参加中信银行网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 6 月 1 日
30	关于旗下基金在申银万国证券开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 6 月 3 日
31	关于增加国金证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 6 月 21 日
32	关于旗下基金参加华夏银行网上银行基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 6 月 25 日
33	关于旗下基金在安信证券开通定投及参加网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 6 月 28 日
34	关于旗下基金继续参加中国邮政储蓄银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 7 月 1 日
35	关于旗下基金参加交通银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 7 月 1 日
36	天弘基金管理有限公司关于旗下基金代销机构名称变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 7 月 8 日
37	关于增加东海证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 7 月 14 日

38	天弘周期策略股票型证券投资基金 2010 年 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 7 月 19 日
39	天弘基金管理有限公司关于广州分公司成立的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 7 月 23 日
40	关于增加国信证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 7 月 29 日
41	关于旗下基金在国信证券开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 7 月 29 日
42	关于增加西南证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 7 月 30 日
43	关于旗下基金在西南证券开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 7 月 30 日
44	关于旗下基金在西南证券开通基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 7 月 30 日
45	天弘周期策略股票型证券投资基金招募说明书 2010 年第 1 次更新及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 7 月 31 日
46	关于增加华宝证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 8 月 3 日
47	关于旗下基金参加华泰联合证券网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 8 月 11 日
48	关于增加西藏同信证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 8 月 13 日
49	关于旗下基金参加中国银河证券股份有限公司网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 8 月 16 日
50	关于旗下基金参加国泰君安证券股份有限公司网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 8 月 18 日
51	天弘周期策略股票型证券投资基金 2010 年半年报及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 8 月 27 日
52	关于旗下基金参加齐鲁证券有限公司网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 8 月 30 日
53	关于旗下基金参加信达证券股份有限公司网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 8 月 31 日
54	关于旗下基金在信达证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 8 月 31 日
55	关于旗下基金参加部分代销机构网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 9 月 2 日
56	关于旗下基金在部分代销机构开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 9 月 2 日
57	关于增加国元证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 9 月 6 日
58	关于调整招商银行一卡通借记卡网上直销申购费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 9 月 17 日

59	关于在国信证券开通旗下基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 9 月 17 日
60	关于旗下基金参加华泰证券网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 9 月 21 日
61	关于在华泰证券开通旗下基金定额定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 9 月 21 日
62	关于增加广发华福证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 10 月 18 日
63	关于在广发华福证券开通旗下基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 10 月 18 日
64	关于在广发华福证券开通旗下基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 10 月 18 日
65	关于旗下基金参加广发华福证券网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 10 月 18 日
66	关于旗下基金在华宝证券开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 11 月 19 日
67	关于增加爱建证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 11 月 23 日
68	关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 11 月 27 日
69	关于旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 11 月 30 日
70	天弘周期策略股票型证券投资基金第 1 次分红预告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 12 月 21 日
71	天弘周期策略股票型证券投资基金第 1 次分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www.thfund.com.cn	2010 年 12 月 27 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘精选混合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托管协议
- 5、天弘基金管理有限公司批准成立批件、营业执照及公司章程
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 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

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及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，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一一年三月二十九日