

天弘周期策略股票型证券投资基金
2012 年年度报告摘要

2012 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 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 2012 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
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§ 5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6 审计报告.....	14
§ 7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§ 8 投资组合报告.....	21
8.1 期末基金资产组合情况.....	21
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	21
8.3 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.....	22
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	22
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	28
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.....	28
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细.....	28
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.....	28

8.9 投资组合报告附注.....	28
§ 9 基金份额持有人信息.....	30
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	30
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	30
§ 10 开放式基金份额变动.....	31
§ 11 重大事件揭示.....	32
11.1 基金份额持有人大会决议.....	32
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.....	32
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	32
11.4 基金投资策略的改变.....	32
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	32
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.....	32
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	32
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	35

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	225,461,681.07 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	童建林	赵会军
	联系电话	022-83310208	010-66105799
	电子邮箱	service@thfund.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

§ 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
本期已实现收益	-37,974,389.94	-1,400,961.88	59,923,005.15
本期利润	2,569,586.50	-75,459,530.57	96,583,656.68
加权平均基金份额本期利润	0.0114	-0.2738	0.1921
本期基金份额净值增长率	3.18%	-25.66%	17.54%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1237	-0.1506	0.1422
期末基金资产净值	197,566,218.25	224,866,089.68	420,177,479.02
期末基金份额净值	0.876	0.849	1.142

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

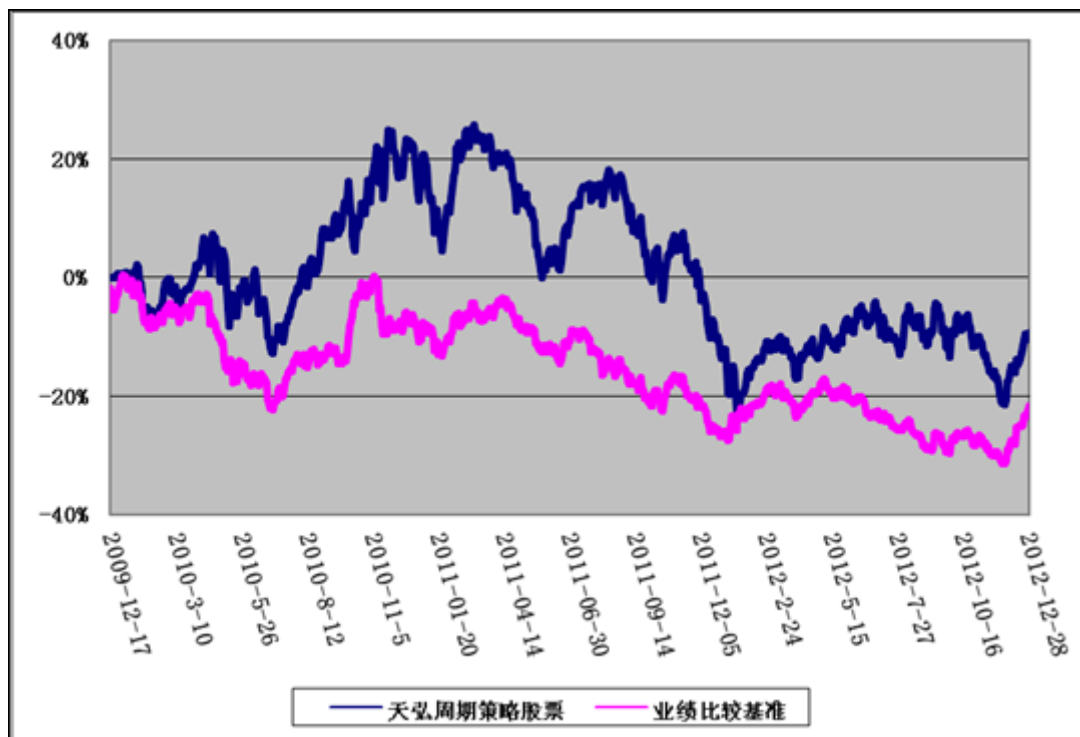
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.45%	1.24%	7.44%	0.96%	-7.89%	0.28%
过去六个月	-2.99%	1.42%	1.66%	0.93%	-4.65%	0.49%
过去一年	3.18%	1.44%	5.83%	0.96%	-2.65%	0.48%
过去三年	-9.84%	1.48%	-21.79%	1.04%	11.95%	0.44%
自基金合同生效起至今	-9.21%	1.47%	-21.51%	1.05%	12.30%	0.42%

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

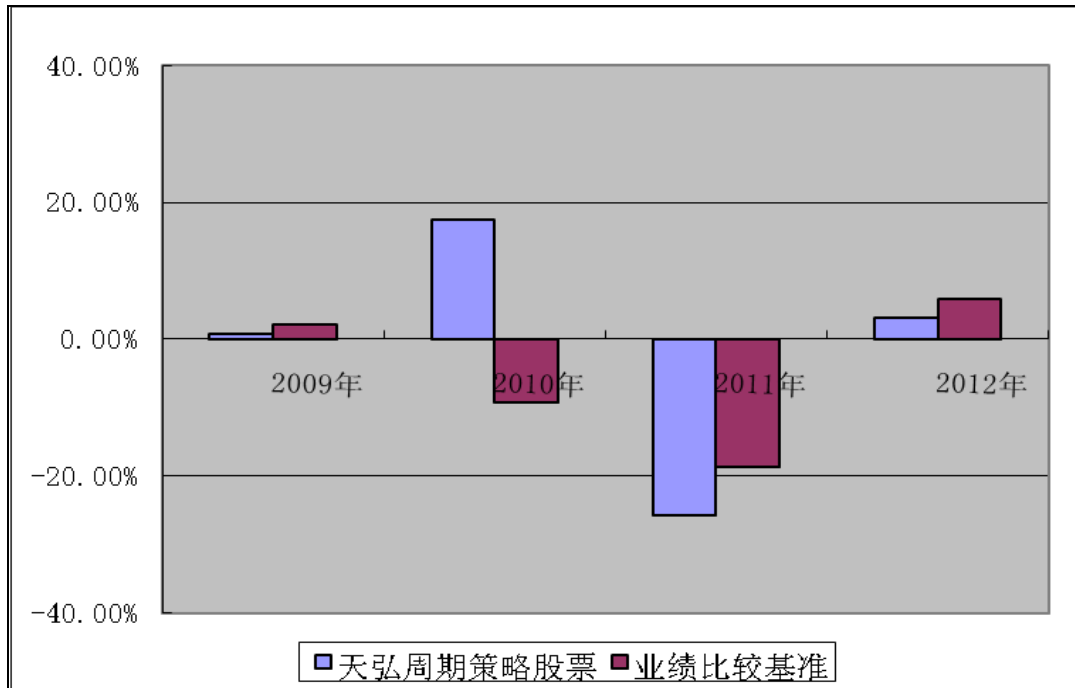
天弘周期策略股票基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2009年12月17日至2012年12月31日)



注：1、本基金合同于2009年12月17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。

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
2012 年	-	-	-	-	无
2011 年	-	-	-	-	无
2010 年	0.420	11,141,168.14	4,136,093.01	15,277,261.15	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（以下简称“公司”或“本公司”）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1.8亿元人民币，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%）。截至2012年12月31日，本基金管理人共管理十只基金：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、天弘永定价值成长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、天弘丰利分级债券型证券投资基金、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康养老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
		任职日期	离任日期		
高喜阳	本基金基金经理；天弘精选混合型证券投资基金基金经理；股票投资部总经理助理。	2011年4月	—	6年	男，工学硕士。历任中原证券股份有限公司研究员；东吴基金管理有限公司研究员。2008年加盟本公司，历任高级研究员、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理。

注：1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

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。

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 公平交易制度和控制方法

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、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统中的公平交易程序，对于不同投资合同同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：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；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以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；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，制定《异常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异常和交易价格异常的情形进行界定，拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内，严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；针对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生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

2012 年经济呈现下滑态势，在政策低于预期、流动性紧平衡、企业盈利下滑的大环境下，市场窄幅波动，机会有限，以地产和银行为代表的低估值和高成长类股票在 2012 年表现较好。

本基金在过去一年中，坚持在大消费和 TMT 等行业中精选成长股的策略，但是在企业盈利下滑的过程中，部分个股业绩低于预期，拖累了基金业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.876 元。本报告期本基金份额净值增长率 3.18%，同期业绩比较基准增长率 5.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013 年经济弱复苏仍将持续，资金仍会保持一个较为宽松的状况，企业盈利筑底回升，流动性推动的估值修复仍然有一定的幅度。

从全年角度看，市场会取得一定幅度的正收益，市场表现会呈现出低估值和高成长均有机会的状况，影响市场节奏的因素主要是通胀的演进和政策的变动，我们倾向于从全年角度看，高成长依然成为全年的超额收益来源。

2013 年，我们看好的行业是大消费、TMT、环保等成长性行业和金融地产等低估值行业。

4.6 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、研究总监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领域工作经历、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、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 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

2012 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

2012 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未进行利润分配。

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 2012 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

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所审计，该所出具了“无保留意见的审计报告”，且在审计报告中无强调事项。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§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：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	18,759,803.83	10,963,071.90
结算备付金		671,117.11	2,446,150.27
存出保证金		1,183,042.68	1,709,273.87
交易性金融资产	7.4.7.2	119,173,708.97	213,329,487.76
其中：股票投资		119,173,708.97	213,329,487.76
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	58,000,000.00	-
应收证券清算款		2,828,143.95	2,097,581.50
应收利息	7.4.7.5	4,310.44	3,583.09
应收股利		-	-
应收申购款		14,532.84	31,422.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		200,634,659.82	230,580,571.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 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		-	2,389,597.06
应付赎回款		361,577.09	101,566.49
应付管理人报酬		237,484.73	305,437.12
应付托管费		39,580.80	50,906.18
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	7.4.7.7	414,527.35	852,091.98
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	2,015,271.60	2,014,882.78
负债合计		3,068,441.57	5,714,481.61
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	225,461,681.07	264,742,166.55
未分配利润	7.4.7.10	-27,895,462.82	-39,876,076.87
所有者权益合计		197,566,218.25	224,866,089.68
负债和所有者权益总计		200,634,659.82	230,580,571.29

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.876 元，基金份额总额 225,461,681.07 份。

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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		10,108,702.09	-62,684,340.87
1. 利息收入		330,320.37	309,207.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	172,821.68	309,207.93
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		157,498.69	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-30,833,531.47	10,678,285.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-32,556,884.67	9,259,319.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
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	1,723,353.20	1,418,965.92
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	40,543,976.44	-74,058,568.69
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	67,936.75	386,734.26

减：二、费用		7,539,115.59	12,775,189.70
1. 管理人报酬		2,898,805.78	4,460,532.16
2. 托管费		483,134.29	743,421.99
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	3,775,879.64	7,187,193.15
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	381,295.88	384,042.40
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,569,586.50	-75,459,530.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,569,586.50	-75,459,530.57

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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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)	264,742,166.55	-39,876,076.87	224,866,089.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,569,586.50	2,569,586.50
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)	-39,280,485.48	9,411,027.55	-29,869,457.93
其中：1. 基金申购款	34,230,649.06	-4,339,167.02	29,891,482.04
2. 基金赎回款	-73,511,134.54	13,750,194.57	-59,760,939.97
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)	225,461,681.07	-27,895,462.82	197,566,218.25
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	367,862,537.04	52,314,941.98	420,177,479.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-75,459,530.57	-75,459,530.57
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)	-103,120,370.49	-16,731,488.28	-119,851,858.77
其中：1. 基金申购款	220,401,578.27	20,879,577.56	241,281,155.83
2. 基金赎回款	-323,521,948.76	-37,611,065.84	-361,133,014.60
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)	264,742,166.55	-39,876,076.87	224,866,089.68

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：

郭 树 强

崔 德 广

薄 贺 龙

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.2 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
内蒙古君正能源化工股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 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。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,898,805.78	4,460,532.16
其中：支付销售机构的客户维护费	400,989.08	572,236.23

注：1、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 1.50% 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 1.50% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	483,134.29	743,421.99

注：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。

7.4.3.3 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。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间本基金基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.3.4.2 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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.5 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		上年度可比期间	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 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	18,759,803.83	154,071.83	10,963,071.90	276,852.44

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。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.4 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 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(2012年12月31日),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。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末(2012年12月31日),本基金未持有因暂时停牌等流通受限股票。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末(2012年12月31日),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。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末(2012年12月31日),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。

§ 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	119,173,708.97	59.40
	其中：股票	119,173,708.97	59.40
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	58,000,000.00	28.91
	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	19,430,920.94	9.68
6	其他各项资产	4,030,029.91	2.01
7	合计	200,634,659.82	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	80,613,704.74	40.80
C0	食品、饮料	5,888,659.16	2.98
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,576,656.60	2.32
C5	电子	19,475,815.31	9.86
C6	金属、非金属	3,867,291.45	1.96
C7	机械、设备、仪表	33,210,870.80	16.81
C8	医药、生物制品	13,594,411.42	6.88

C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,573,515.67	1.30
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	21,450,578.50	10.86
H	批发和零售贸易	3,210,515.04	1.63
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	4,452,361.92	2.25
K	社会服务业	6,143,815.18	3.11
L	传播与文化产业	729,217.92	0.37
M	综合类	-	-
	合计	119,173,708.97	60.32

8.3 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

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	002638	勤上光电	700,202	7,422,141.20	3.76
2	002358	森源电气	597,995	7,259,659.30	3.67
3	600703	三安光电	509,653	6,972,053.04	3.53
4	002649	博彦科技	432,851	6,878,002.39	3.48
5	300020	银江股份	474,263	6,061,081.14	3.07
6	002304	洋河股份	63,068	5,888,659.16	2.98
7	300267	尔康制药	291,034	5,573,301.10	2.82
8	300259	新天科技	414,155	5,239,060.75	2.65
9	002456	欧菲光	112,562	4,724,227.14	2.39
10	300070	碧水源	107,336	4,304,173.60	2.18

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	002410	广联达	24,335,138.60	10.82
2	600702	沱牌舍得	23,661,068.95	10.52
3	002638	勤上光电	23,452,192.14	10.43
4	002358	森源电气	17,774,558.24	7.90

5	000401	冀东水泥	17,307,286.56	7.70
6	300070	碧水源	16,042,456.76	7.13
7	300267	尔康制药	15,151,656.48	6.74
8	600048	保利地产	14,965,155.01	6.66
9	002546	新联电子	14,604,474.08	6.49
10	002503	搜于特	14,557,581.41	6.47
11	600376	首开股份	14,083,848.45	6.26
12	300275	梅安森	14,033,238.84	6.24
13	600703	三安光电	14,010,846.01	6.23
14	300301	长方照明	13,723,911.20	6.10
15	300105	龙源技术	13,706,048.11	6.10
16	600104	上汽集团	13,487,471.71	6.00
17	300020	银江股份	12,927,734.05	5.75
18	002397	梦洁家纺	12,888,929.71	5.73
19	000157	中联重科	12,478,374.08	5.55
20	002649	博彦科技	11,890,488.51	5.29
21	600383	金地集团	11,843,965.86	5.27
22	000596	古井贡酒	11,133,435.20	4.95
23	300306	远方光电	10,977,105.60	4.88
24	601233	桐昆股份	10,794,181.16	4.80
25	300298	三诺生物	10,578,797.27	4.70
26	601601	中国太保	10,365,055.47	4.61
27	300302	同有科技	10,340,575.87	4.60
28	300259	新天科技	10,131,067.90	4.51
29	002005	德豪润达	10,082,771.12	4.48
30	300309	吉艾科技	10,029,728.73	4.46
31	002456	欧菲光	9,668,303.34	4.30
32	300128	锦富新材	9,501,548.15	4.23
33	002475	立讯精密	9,472,916.61	4.21
34	601166	兴业银行	9,203,795.34	4.09
35	601866	中海集运	9,098,190.14	4.05
36	300274	阳光电源	9,026,325.05	4.01
37	002341	新纶科技	8,948,432.08	3.98
38	600199	金种子酒	8,684,546.47	3.86
39	000799	酒鬼酒	8,683,510.47	3.86
40	300170	汉得信息	8,581,899.80	3.82
41	002236	大华股份	8,394,435.08	3.73
42	600805	悦达投资	8,391,818.23	3.73
43	601669	中国水电	8,384,430.00	3.73

44	300323	华灿光电	8,244,387.14	3.67
45	600546	山煤国际	8,237,639.07	3.66
46	601872	招商轮船	8,206,098.43	3.65
47	600406	国电南瑞	8,187,166.19	3.64
48	601919	中国远洋	7,834,059.99	3.48
49	002185	华天科技	7,721,279.01	3.43
50	603366	日出东方	7,676,881.06	3.41
51	300168	万达信息	7,644,211.11	3.40
52	300002	神州泰岳	7,487,942.26	3.33
53	600261	阳光照明	7,402,580.60	3.29
54	601918	国投新集	7,346,238.37	3.27
55	600963	岳阳林纸	7,244,531.41	3.22
56	002146	荣盛发展	7,152,189.72	3.18
57	002415	海康威视	7,067,745.02	3.14
58	600965	福成五丰	7,045,623.55	3.13
59	600026	中海发展	6,995,284.81	3.11
60	300315	掌趣科技	6,979,816.41	3.10
61	300313	天山生物	6,967,959.62	3.10
62	000090	深天健	6,893,595.34	3.07
63	000568	泸州老窖	6,862,997.74	3.05
64	002322	理工监测	6,448,699.43	2.87
65	000046	泛海建设	6,396,702.80	2.84
66	300150	世纪瑞尔	6,375,406.28	2.84
67	600372	中航电子	6,325,567.80	2.81
68	002304	洋河股份	6,241,374.07	2.78
69	600585	海螺水泥	6,189,805.42	2.75
70	002635	安洁科技	6,184,826.74	2.75
71	000712	锦龙股份	6,035,599.16	2.68
72	000933	神火股份	5,986,295.00	2.66
73	300316	晶盛机电	5,980,254.53	2.66
74	300115	长盈精密	5,959,070.18	2.65
75	000069	华侨城 A	5,855,872.08	2.60
76	000998	隆平高科	5,609,311.87	2.49
77	000895	双汇发展	5,573,318.49	2.48
78	002285	世联地产	5,536,422.82	2.46
79	000540	中天城投	5,492,875.00	2.44
80	600395	盘江股份	5,091,251.41	2.26
81	000002	万科 A	5,089,493.43	2.26
82	300124	汇川技术	5,072,200.41	2.26

83	000671	阳光城	4,963,669.84	2.21
84	000651	格力电器	4,860,947.11	2.16
85	002041	登海种业	4,791,773.86	2.13
86	600720	祁连山	4,737,651.50	2.11
87	601699	潞安环能	4,693,656.62	2.09
88	002065	东华软件	4,687,187.10	2.08
89	300285	国瓷材料	4,612,474.79	2.05
90	600837	海通证券	4,596,429.88	2.04

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	002410	广联达	38,426,513.52	17.09
2	002546	新联电子	29,951,204.61	13.32
3	002397	梦洁家纺	26,451,931.26	11.76
4	600702	沱牌舍得	24,910,896.87	11.08
5	300267	尔康制药	18,955,827.68	8.43
6	300124	汇川技术	17,524,443.77	7.79
7	002503	搜于特	17,128,442.34	7.62
8	300062	中能电气	16,950,568.74	7.54
9	000401	冀东水泥	16,659,873.58	7.41
10	300105	龙源技术	16,086,823.94	7.15
11	300070	碧水源	16,048,321.00	7.14
12	002475	立讯精密	14,627,287.33	6.50
13	300275	梅安森	14,338,369.79	6.38
14	600104	上汽集团	13,976,522.47	6.22
15	002638	勤上光电	13,917,155.92	6.19
16	000799	酒鬼酒	13,909,256.69	6.19
17	600376	首开股份	13,617,818.12	6.06
18	600048	保利地产	13,439,738.94	5.98
19	300301	长方照明	13,074,863.96	5.81
20	000596	古井贡酒	12,983,192.86	5.77
21	002358	森源电气	12,710,796.82	5.65
22	300298	三诺生物	12,522,713.38	5.57
23	000157	中联重科	12,406,314.53	5.52
24	600383	金地集团	11,596,558.10	5.16

25	002322	理工监测	11,561,307.94	5.14
26	300302	同有科技	11,171,214.27	4.97
27	600805	悦达投资	11,164,258.39	4.96
28	601233	桐昆股份	11,152,837.66	4.96
29	300306	远方光电	10,632,276.32	4.73
30	300309	吉艾科技	9,758,314.82	4.34
31	601601	中国太保	9,379,841.74	4.17
32	002005	德豪润达	9,348,906.82	4.16
33	600199	金种子酒	9,304,755.11	4.14
34	601866	中海集运	9,292,245.07	4.13
35	002236	大华股份	8,988,494.00	4.00
36	300020	银江股份	8,844,578.88	3.93
37	002375	亚厦股份	8,687,056.45	3.86
38	601166	兴业银行	8,682,580.30	3.86
39	300170	汉得信息	8,612,578.26	3.83
40	300274	阳光电源	8,589,028.89	3.82
41	300128	锦富新材	8,356,162.04	3.72
42	300074	华平股份	8,259,475.84	3.67
43	600372	中航电子	8,249,760.73	3.67
44	601669	中国水电	8,169,170.56	3.63
45	601919	中国远洋	8,033,822.45	3.57
46	600546	山煤国际	8,029,785.30	3.57
47	601872	招商轮船	7,918,637.09	3.52
48	002185	华天科技	7,763,206.58	3.45
49	002146	荣盛发展	7,746,662.60	3.45
50	002635	安洁科技	7,440,238.51	3.31
51	300002	神州泰岳	7,181,749.81	3.19
52	600703	三安光电	7,178,433.12	3.19
53	000888	峨眉山A	7,149,665.41	3.18
54	600963	岳阳林纸	7,140,776.96	3.18
55	603366	日出东方	7,114,198.91	3.16
56	600026	中海发展	7,111,993.83	3.16
57	002298	鑫龙电器	7,060,618.68	3.14
58	600261	阳光照明	7,053,989.68	3.14
59	000090	深天健	7,011,270.00	3.12
60	300313	天山生物	6,939,236.58	3.09
61	300323	华灿光电	6,899,660.89	3.07
62	002285	世联地产	6,875,464.39	3.06
63	000933	神火股份	6,753,803.13	3.00

64	002341	新纶科技	6,745,618.62	3.00
65	600965	福成五丰	6,727,458.29	2.99
66	300316	晶盛机电	6,620,857.54	2.94
67	000046	泛海建设	6,610,385.04	2.94
68	300315	掌趣科技	6,598,921.00	2.93
69	000568	泸州老窖	6,543,153.97	2.91
70	300115	长盈精密	6,313,900.31	2.81
71	601918	国投新集	6,125,375.33	2.72
72	300168	万达信息	6,057,352.18	2.69
73	002649	博彦科技	6,022,629.95	2.68
74	000712	锦龙股份	5,993,439.71	2.67
75	000423	东阿阿胶	5,886,745.33	2.62
76	300150	世纪瑞尔	5,851,491.67	2.60
77	002456	欧菲光	5,849,097.48	2.60
78	000998	隆平高科	5,765,944.62	2.56
79	002415	海康威视	5,728,136.16	2.55
80	000895	双汇发展	5,614,656.89	2.50
81	000540	中天城投	5,439,001.53	2.42
82	300253	卫宁软件	5,400,553.80	2.40
83	000069	华侨城 A	5,261,463.80	2.34
84	000671	阳光城	5,260,564.34	2.34
85	000002	万科 A	5,130,085.32	2.28
86	600720	祁连山	5,053,579.77	2.25
87	002041	登海种业	5,040,522.60	2.24
88	300259	新天科技	4,951,809.72	2.20
89	600395	盘江股份	4,837,454.44	2.15
90	000651	格力电器	4,820,313.23	2.14
91	300031	宝通带业	4,800,579.53	2.13
92	300096	易联众	4,760,766.13	2.12
93	300285	国瓷材料	4,706,919.29	2.09
94	002430	杭氧股份	4,500,019.47	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	1,178,957,124.52
卖出股票收入（成交）总额	1,281,099,995.08

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	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	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。

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 本报告期内未发现本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	1,183,042.68
2	应收证券清算款	2,828,143.95
3	应收股利	-
4	应收利息	4,310.44
5	应收申购款	14,532.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	合计	4,030,029.91

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
4,311	52,299.16	143,325,037.97	63.57%	82,136,643.10	36.43%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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 持有本基金	130,072.63	0.06%

§ 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	264,742,166.55
报告期期间基金总申购份额	34,230,649.06
减：报告期期间基金总赎回份额	73,511,134.54
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	225,461,681.07

注：总申购份额含转换入份额；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，经天弘基金管理有限公司第三届董事会 2012 年第 3 次会议审议通过以下事项：吕传红先生因个人原因，不再担任公司督察长职务，经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]537 号文核准批复，由童建林先生担任公司督察长职务。

本报告期内本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 3 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	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	
国金证券	1	378,121,889.78	15.37%	309,519.13	14.88%	无
东北证券	1	299,842,629.85	12.19%	264,075.97	12.70%	无
上海证券	1	258,716,311.25	10.52%	212,543.00	10.22%	无
华泰证券	3	190,784,646.69	7.76%	160,939.78	7.74%	无
招商证券	1	187,335,464.87	7.62%	158,870.24	7.64%	无
高华证券	1	178,490,309.07	7.26%	149,645.32	7.19%	无
华创证券	1	154,775,578.75	6.29%	128,813.35	6.19%	无
中信证券	4	141,654,846.41	5.76%	125,748.29	6.05%	无
中信建投证券	2	112,068,887.63	4.56%	98,100.53	4.72%	无
齐鲁证券	2	91,074,081.10	3.70%	77,413.15	3.72%	无
国信证券	1	78,389,315.26	3.19%	66,701.00	3.21%	无
民生证券	1	70,903,640.66	2.88%	57,721.31	2.77%	无
安信证券	1	67,585,218.70	2.75%	56,375.98	2.71%	无
中投证券	1	53,696,561.01	2.18%	45,642.43	2.19%	无
中金公司	1	46,567,222.34	1.89%	39,868.76	1.92%	无
国联证券	1	45,701,135.86	1.86%	39,647.49	1.91%	无
国泰君安证券	1	43,046,218.06	1.75%	37,789.94	1.82%	无
申银万国证券	2	40,570,945.52	1.65%	32,964.09	1.58%	无
东方证券	2	10,706,964.80	0.44%	9,086.50	0.44%	无
光大证券	1	8,080,006.36	0.33%	6,867.91	0.33%	无
长江证券	1	1,935,245.63	0.08%	1,761.77	0.08%	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。

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	东北证券	上海	1
2	国联证券	上海	1

3	东方证券	深圳	1
4	中信证券	深圳	2
5	华泰证券	深圳	1
6	上海证券	深圳	1
7	中国银河证券	上海、深圳	各 1

4、本基金报告期内停止租用交易单元情况

序号	证券公司名称	所属市场	数量
1	中邮证券	上海	1
2	华泰证券	上海	1
3	华宝证券	上海	1
4	山西证券	上海	1
5	中银国际证券	深圳	1
6	西藏同信证券	上海、深圳	各 1
7	英大证券	上海、深圳	各 1

§12 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金管理人 2012 年 3 月 16 日发布的公告，经中国证监会证监许可[2012]196 号文核准，本基金的基金管理人的注册资本由原来的壹亿元人民币增加至壹亿捌仟元人民币，公司股东的出资比例不变。注册资本增加完成后，本基金的基金管理人于公告日前完成了相关工商登记变更手续。

天弘基金管理有限公司
二〇一三年三月二十九日