

天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）
2014年半年度报告

2014年06月30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

送出日期：2014年08月26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。本半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2014年8月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

1.2 目录

1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 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	10
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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	39
7.7 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	39
7.8 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贵金属投资明细	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末上市基金前十名持有人	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	42
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
10.2 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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45

10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	45
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8	其他重大事件	46
§ 11	备查文件目录.....	48
11.1	备查文件目录	48
11.2	存放地点	48
11.3	查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）
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08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	88,167,325.47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09月17日

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股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和成份股将发生分红、配股、增发等行为时，或者因特殊情况（如成份股停牌、成份股流动性受限等）导致基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整，并可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。
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%

风险收益特征	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
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@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
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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2014年01月01日-2014年06月30日)
本期已实现收益	-4,742,212.19
本期利润	-5,267,348.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0588
本期加权平均净值利润率	-9.91%
本期基金份额净值增长率	-8.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2014年06月30日)
期末可供分配利润	-36,165,885.73
期末可供分配基金份额利润	-0.4102
期末基金资产净值	52,001,439.74
期末基金份额净值	0.590
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2014年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-41.00%

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

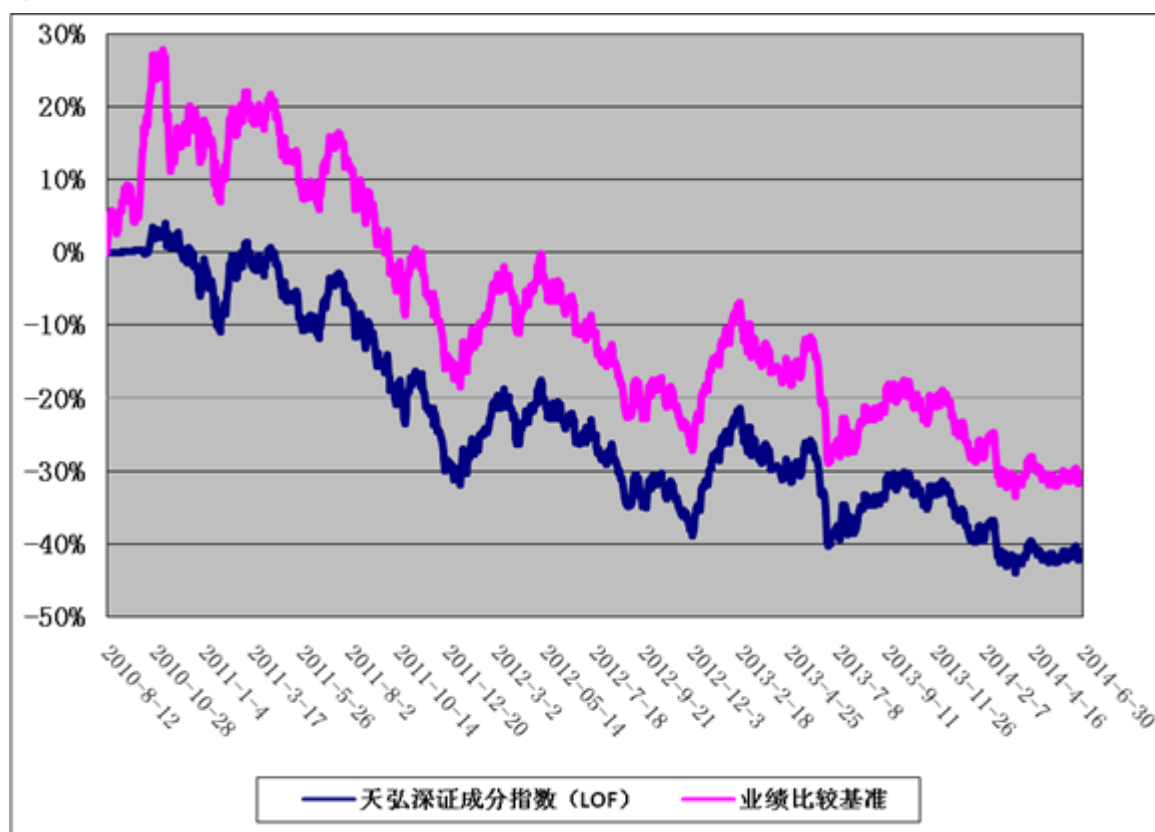
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.17%	0.81%	-0.27%	0.85%	0.44%	-0.04%
过去三个月	2.79%	0.84%	2.05%	0.86%	0.74%	-0.02%
过去六个月	-8.95%	1.09%	-9.08%	1.11%	0.13%	-0.02%

过去一年	-3.75%	1.18%	-4.22%	1.19%	0.47%	-0.01%
过去三年	-37.17%	1.32%	-37.55%	1.32%	0.38%	0.00%
自基金合同生效日起 至今（2010年08月12 日-2014年06月30日）	-41.00%	1.27%	-30.31%	1.35%	-10.69%	-0.08%

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，以此为业绩比较基准，能够准确地反映本基金的投资绩效。

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



- 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（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。注册资本金为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2014年6月30日，本基金管理人共管理十六只基金：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、天弘增利宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金和天弘季加利理财债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）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		
李蕴炜	本基金基金经理；股票研究部副总经理。	2012年03月	—	8年	男，经济学硕士。历任亚洲证券有限责任公司股票分析师、Ophedge investment services运营分析师。2007年加盟本公司，历任交易员、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助理、天弘永定价值成长股票型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。

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

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。

4.3.2 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

上半年我国经济增长出现了放缓企稳的迹象，各项宏观经济数据在一定程度上有所提升，汇丰及中采PMI均回升到50以上。工业企业并没有因为GDP增速下滑而出现利润大幅下滑的情况；相反在GDP增速下滑的情况下，其保持了稳定的增长，前5个月利润总额同比增长9%。在41个工业大类行业中，32个行业利润总额同比增长，1个持平，8个下降。下降的行业为原材料开采、有色冶金和白酒饮料行业。

上半年市场延续低迷格局，除个别概念板块表现较好外，其他的整体表现一般。市场的存量博弈特征愈发明显，博弈的板块和品种越来越少，说明市场已经进入纠结盘局的末端，等待新变化因素的出现来改变市场的运行状态。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日，本基金份额净值为0.590元。本报告期本基金份额净值增长率-8.95%，同期业绩比较基准增长率-9.08%。报告期内，日均跟踪误差为0.1068%，年化跟踪误差为1.6471%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着国内经济发展企稳，新趋势已经逐步明朗，在国家及国企改革制度的大趋势下，各类企业的盈利模式也将被重构。在外部环境发生颠覆式变化的情况下，如果具有国企改革背景的企业能够更快地理解外部环境的变化并对这种变化及时做出恰当的反应，从而更好地适应新的外部环境，那么这类企业必然在未来的竞争格局中占据先机，从而获得更多匹配的资源。在这个过程中，产业方面的机遇将不断涌现，与此对应的资本市场机会也将层出不穷。

就中国资本市场本身来讲，转型已进入实质阶段：反腐成果不断巩固、去地产化正式开始、国企改革逐步加速，这些都将使中国巨大的存量资产得到效率上的显著改善，也会给中国市场经济的健康发展和资本市场的持续壮大提供坚实的基础。以上是中长期看好中国资本市场的两大主因。

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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的约定。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）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

本报告期内，天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）的管理人--天弘基金管理有限公司在天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）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，天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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深证成份指数证券投资基金（LOF）2014年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2014年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年06月30日	上年度末 2013年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,507,677.99	3,399,879.21
结算备付金		—	—
存出保证金		1,388.96	1,790.99
交易性金融资产	6.4.7.2	46,914,558.73	55,570,049.96
其中：股票投资		46,914,558.73	55,570,049.96
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	274,148.90
应收利息	6.4.7.5	733.76	754.39
应收股利		—	—
应收申购款		1,978,264.88	9,340.75
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	30,247.09	—
资产总计		52,432,871.41	59,255,964.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年06月30日	上年度末 2013年12月31日
负债：			
短期借款		—	—

交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		13,753.08	102,246.11
应付管理人报酬		30,780.15	38,314.85
应付托管费		6,156.02	7,662.93
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	2,216.93	2,580.29
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	378,525.49	382,885.99
负债合计		431,431.67	533,690.17
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	88,167,325.47	90,667,414.79
未分配利润	6.4.7.1 0	-36,165,885.73	-31,945,140.76
所有者权益合计		52,001,439.74	58,722,274.03
负债和所有者权益总计		52,432,871.41	59,255,964.20

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.590元，基金份额总额88,167,325.47份。

6.2 利润表

会计主体：天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2014年01月01日-2014年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2014年01月 01日-2014年06 月30日	上年度可比期间 2013年01月01日 -2013年06月30日
一、收入		-4,604,692.26	-9,758,821.30

1. 利息收入		15,394.39	15,253.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,394.39	15,253.69
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		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,095,996.58	-5,476,345.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,856,848.47	-6,030,616.77
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	—
股利收益	6.4.7.15	760,851.89	554,271.10
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-525,136.75	-4,299,917.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,046.68	2,188.44
减：二、费用		662,656.68	580,800.82
1. 管理人报酬		197,971.28	267,348.58
2. 托管费		39,594.25	53,469.73
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.18	21,953.74	33,549.24
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7.19	403,137.41	226,433.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,267,348.94	-10,339,622.12
减：所得税费用		—	—

四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-5,267,348.94	-10,339,622.12
--------------------	--	---------------	----------------

注：后附6.4报表附注为财务报表的组合部分。

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：天弘深证成份指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2014年01月01日-2014年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年01月01日-2014年06月30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)	90,667,414.79	-31,945,140.76	58,722,274.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	—	-5,267,348.94	-5,267,348.94
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)	-2,500,089.32	1,046,603.97	-1,453,485.35
其中：1. 基金申购款	7,151,274.44	-2,902,247.14	4,249,027.30
2. 基金赎回款 (以“-”号填列)	-9,651,363.76	3,948,851.11	-5,702,512.65
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)	88,167,325.47	-36,165,885.73	52,001,439.74
项 目	上年度可比期间 2013年01月01日-2013年06月30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)	103,568,905.76	-28,924,811.08	74,644,094.68
二、本期经营活动产生的基金	—	-10,339,622.1	-10,339,622.12

净值变动数(本期利润)		2	
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)	-8,303,445.55	2,402,949.69	-5,900,495.86
其中：1. 基金申购款	2,148,894.97	-625,333.90	1,523,561.07
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-10,452,340.52	3,028,283.59	-7,424,056.93
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)	95,265,460.21	-36,861,483.51	58,403,976.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

韩海潮

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

主管会计工作负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)(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”)证监基金字[2010]第666号《关于核准天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)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《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)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440,562,172.73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(2010)第203号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》于2010年8月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为440,630,636.78份基金份额,其中认购资金利息折合68,464.05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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第281号文审核同意,本基金25,552,506份基金份额于2010年9月17日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市

流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括深证成份指数成份股、备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金采用指数复制投资策略,股票资产跟踪的标的指数为深证成份指数,资产配置比例为:股票资产投资比例不低于基金资产净值的90%-95%,其中,投资于深证成份指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;现金、债券资产及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-10%,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。本基金的业绩比较基准为:深证成份指数收益率 \times 95%+银行同业存款利率 \times 5%。本基金标的指数使用费由基金管理人天弘基金管理有限公司承担,不计入本基金费用。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》和如财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年度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2014年6月30日的财务状况以及2014年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策和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会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年06月30日
活期存款	3,507,677.99
合计	3,507,677.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	65,420,387.49	46,914,558.73	-18,505,828.76

贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		65,420,387.49	46,914,558.73	-18,505,828.76

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年06月30日
应收活期存款利息	733.16
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	0.60
合计	733.76

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年06月30日
其他应收款	—
待摊费用	30,247.09
合计	30,247.09

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年06月30日
交易所市场应付交易费用	2,216.93
银行间市场应付交易费用	—
合计	2,216.93

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	7.00
预提费用	278,518.49
其他应付	100,000.00
合计	378,525.49

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2014年01月01日-2014年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	90,667,414.79	90,667,414.79

本期申购	7,151,274.44	7,151,274.44
本期赎回 (以“-”号填列)	-9,651,363.76	-9,651,363.76
本期末	88,167,325.47	88,167,325.47

6.4.7.10 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	-16,924,097.97	-15,021,042.79	-31,945,140.76
本期利润	-4,742,212.19	-525,136.75	-5,267,348.94
本期基金份额交易产生的变动数	553,884.09	492,719.88	1,046,603.97
其中：基金申购款	-1,682,210.84	-1,220,036.30	-2,902,247.14
基金赎回款 (以“-”号填列)	2,236,094.93	1,712,756.18	3,948,851.11
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-21,112,426.07	-15,053,459.66	-36,165,885.73

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2014年01月01日-2014年06月30日
活期存款利息收入	15,332.08
结算备付金利息收入	49.01
其他	13.30
合计	15,394.39

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日-2014年06月30日
卖出股票成交总额	8,295,748.38

减：卖出股票成本总额	13,152,596.85
买卖股票差价收入	-4,856,848.47

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期未发生债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未发生衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日-2014年06月30日
股票投资产生的股利收益	760,851.89
基金投资产生的股利收益	—
合计	760,851.89

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日-2014年06月30日
1. 交易性金融资产	-525,136.75
——股票投资	-525,136.75
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—

3. 其他	—
合计	-525,136.75

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年01月01日-2014年06月30日
基金赎回费收入	1,046.68
合计	1,046.68

注：本基金的场内赎回费率为0.5%，场外赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年01月01日-2014年06月30日
交易所市场交易费用	21,953.74
银行间市场交易费用	—
合计	21,953.74

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年01月01日-2014年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
汇划手续费	1,082.77
指数使用费	193,783.24
上市费	29,752.91
合计	403,137.41

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年01月01日-2014年 06月30日	2013年01月01日-2013年06月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	197,971.28	267,348.58
其中：支付销售机构的客户维护费	90,180.23	123,670.93

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0.75%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X0.75%/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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年01月01日-2014年06月30日	2013年01月01日-2013年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	39,594.25	53,469.73

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0.15%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×0.15%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金份额。

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除管理人之外的其他关联方未投资本基金份额。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2014年01月01日-2014年06月30日		2013年01月01日-2013年06月30日	
	期末余额	当期存款利息收入	期末余额	当期存款利息收入
中国工商银行活期存款	3,507,677.99	15,332.08	3,577,422.73	15,005.56

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。

6.4.10.6 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交易。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配情况。

6.4.12 期末（2014年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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（2014年6月30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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量	期末 成本总额	期末 估值总额
000562	宏源证券	2013-10-30	重大 资产 重组	8.22	2014-07-28	8.93	76,355	635,516.83	627,638.10

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用指数复制投资策略，标的指数为深证成份指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险管理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。在董事会下设立审计与风险控制委员会，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，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制。

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。

6.4.13.2 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。

本基金的基金管理人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2014年6月30日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 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、组合在短时间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的投资品种比例等。本基金投资于同一机构发行的证券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同一机构发行的具有投票权的证券不得超过该类证券发行总量的10%。

本基金所持证券均在证券交易所上市，除若附注6.4.12中存在流通暂时受限制不能自由转让的部分基金资产情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现，除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2014年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,507,677.99	—	—	—	3,507,677.99
存出保证金	1,388.96	—	—	—	1,388.96
交易性金融资产	—	—	—	46,914,558.73	46,914,558.73
应收利息	—	—	—	733.76	733.76
应收申购款	—	—	—	1,978,264.88	1,978,264.88
其他资产	—	—	—	30,247.09	30,247.09
资产总计	3,509,066.95	—	—	48,923,804.46	52,432,871.41
负债					
应付赎回款	—	—	—	13,753.08	13,753.08
应付管理人报酬	—	—	—	30,780.15	30,780.15
应付托管费	—	—	—	6,156.02	6,156.02
应付交易费用	—	—	—	2,216.93	2,216.93
其他负债	—	—	—	378,525.49	378,525.49
负债总计	—	—	—	431,431.67	431,431.67
利率敏感度缺口	3,509,066.95	—	—	48,492,372.79	52,001,439.74
上年度末2013年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,399,879.21	—	—	—	3,399,879.21
存出保证金	1,790.99	—	—	—	1,790.99
交易性金融资产	—	—	—	55,570,049.96	55,570,049.96
应收证券清算款	—	—	—	274,148.90	274,148.90
应收利息	—	—	—	754.39	754.39
应收申购款	—	—	—	9,340.75	9,340.75
资产总计	3,401,670.20	—	—	55,854,294.00	59,255,964.20
负债					
应付赎回款	—	—	—	102,246.11	102,246.11
应付管理人报酬	—	—	—	38,314.85	38,314.85

应付托管费	—	—	—	7,662.93	7,662.93
应付交易费用	—	—	—	2,580.29	2,580.29
其他负债	—	—	—	382,885.99	382,885.99
负债总计	—	—	—	533,690.17	533,690.17
利率敏感度缺口	3,401,670.20	—	—	55,320,603.83	58,722,274.03

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2014年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为深证成份指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。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，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	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	46,914,558.73	90.22	55,570,049.96	94.63

交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	46,914,558.73	90.22	55,570,049.96	94.63

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)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:人民币元)	
		本期末	上年度末
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	2,552,600.00	2,957,600.00
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-2,552,600.00	-2,957,600.00

6.4.14 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

(1)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。

(2)以公允价值计量的金融工具

(a)金融工具公允价值计量的方法

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)。

(b) 各层级金融工具公允价值

于2014年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层级的余额为46,286,920.63元，属于第二层级的余额为627,638.10元，无属于第三层级的余额（2013年12月31日：第一层级53,594,311.76元，属于第二层级的余额为1,975,738.20，无属于第三层级的余额）。

(c) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(d) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	46,914,558.73	89.48
	其中：股票	46,914,558.73	89.48
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	3,507,677.99	6.69
7	其他各项资产	2,010,634.69	3.83
8	合计	52,432,871.41	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	1,233,056.14	2.37
C	制造业	28,504,992.04	54.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	713,140.08	1.37
F	批发和零售业	1,625,554.88	3.13

G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	7,142,335.15	13.73
K	房地产业	5,818,455.10	11.19
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	1,877,025.34	3.61
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	46,914,558.73	90.22

7.2.2 报告期末 (积极投资) 按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	000002	万科A	523,873	4,332,429.71	8.33
2	000651	格力电器	136,346	4,015,389.70	7.72
3	000001	平安银行	305,135	3,023,887.85	5.82
4	000333	美的集团	103,992	2,009,125.44	3.86
5	000858	五粮液	109,248	1,958,816.64	3.77
6	000776	广发证券	178,614	1,750,417.20	3.37
7	002024	苏宁云商	247,798	1,625,554.88	3.13
8	000063	中兴通讯	112,792	1,479,831.04	2.85
9	000895	双汇发展	37,594	1,345,489.26	2.59

10	000538	云南白药	25,152	1,312,934.40	2.52
11	002415	海康威视	75,561	1,280,003.34	2.46
12	000625	长安汽车	97,317	1,197,972.27	2.30
13	000157	中联重科	256,608	1,136,773.44	2.19
14	002594	比亚迪	23,908	1,135,390.92	2.18
15	002241	歌尔声学	42,554	1,134,489.64	2.18
16	000423	东阿阿胶	33,315	1,110,055.80	2.13
17	000338	潍柴动力	61,498	1,094,049.42	2.10
18	000100	TCL 集团	464,207	1,058,391.96	2.04
19	000783	长江证券	106,882	1,026,067.20	1.97
20	000725	京东方 A	471,933	1,024,094.61	1.97
21	000069	华侨城 A	204,886	960,915.34	1.85
22	002353	杰瑞股份	22,881	920,960.25	1.77
23	300070	碧水源	31,320	916,110.00	1.76
24	000402	金融街	145,155	791,094.75	1.52
25	002304	洋河股份	15,483	785,762.25	1.51
26	002236	大华股份	28,930	779,663.50	1.50
27	000768	中航飞机	69,749	734,456.97	1.41
28	002142	宁波银行	77,644	714,324.80	1.37
29	002081	金螳螂	50,363	713,140.08	1.37
30	000024	招商地产	66,692	694,930.64	1.34
31	000623	吉林敖东	44,711	693,914.72	1.33
32	000568	泸州老窖	42,265	692,300.70	1.33
33	000562	宏源证券	76,355	627,638.10	1.21
34	000792	盐湖股份	37,457	564,476.99	1.09
35	000983	西山煤电	95,841	505,082.07	0.97
36	000629	攀钢钒钛	227,622	473,453.76	0.91
37	000425	徐工机械	67,891	465,053.35	0.89
38	000630	铜陵有色	44,853	401,882.88	0.77
39	000937	冀中能源	43,657	254,520.31	0.49

40	000869	张裕A	7,205	173,712.55	0.33
----	--------	-----	-------	------------	------

7.3.2 积极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

本基金报告期末未持有积极投资股票。

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	002236	大华股份	1,284,024.75	2.19
2	002353	杰瑞股份	1,262,822.51	2.15
3	300070	碧水源	1,104,531.93	1.88
4	002594	比亚迪	1,087,768.18	1.85
5	002415	海康威视	230,670.00	0.39
6	002024	苏宁云商	52,425.00	0.09

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。

7.4.2 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	000651	格力电器	631,707.18	1.08
2	000002	万科A	622,315.51	1.06
3	000060	中金岭南	519,244.19	0.88
4	002024	苏宁云商	453,155.70	0.77
5	000878	云南铜业	442,431.09	0.75
6	000333	美的集团	423,522.50	0.72
7	000001	平安银行	415,611.30	0.71
8	000960	锡业股份	351,449.47	0.60
9	000401	冀东水泥	311,373.32	0.53

10	000776	广发证券	262,431.30	0.45
11	000895	双汇发展	258,111.42	0.44
12	000538	云南白药	244,437.44	0.42
13	000625	长安汽车	234,088.20	0.40
14	000063	中兴通讯	221,992.90	0.38
15	000858	五粮液	220,144.49	0.37
16	002241	歌尔声学	214,966.07	0.37
17	000423	东阿阿胶	182,362.52	0.31
18	000157	中联重科	180,338.67	0.31
19	002594	比亚迪	158,048.37	0.27
20	000100	TCL 集团	150,311.51	0.26

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	5,022,242.37
卖出股票的收入（成交）总额	8,295,748.38

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,388.96
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	733.76
5	应收申购款	1,978,264.88
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	2,010,634.69

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
2,653	33,233.07	—	—	88,167,325.47	100.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	孙雪英	95,000.00	7.61%
2	钟新胜	75,500.00	6.05%
3	左磊	73,907.00	5.92%
4	崔秀岩	62,600.00	5.02%
5	窦志平	60,001.00	4.81%
6	刘瑛	40,000.00	3.21%
7	王旭升	30,000.00	2.40%
8	杨永照	30,000.00	2.40%
9	梁志坤	25,400.00	2.04%
10	宋青骥	24,700.00	1.98%

8.3 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	171.08	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	—

本基金基金经理持有本开放式基金	-
-----------------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年08月12日)基金份额总额	440,630,636.78
本报告期期初基金份额总额	90,667,414.79
本报告期基金总申购份额	7,151,274.44
减：本报告期基金总赎回份额	9,651,363.76
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	88,167,325.47

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内本基金的基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期内未发现本基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	13,317,990.75	100.00%	—	—	—	—	—	—	12,124.74	100.00%	

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	兴业证券	深圳	1
2	国泰君安证券	深圳	1

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于增加南京银行股份有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2014-01-09
2	天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）2013年第4季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2014-01-21
3	天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）2013年年度报告及摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2014-03-27
4	天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）招募说明书更新及摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2014-03-28
5	天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）2013年年度报告及摘要补充公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2014-03-29
6	天弘基金管理有限公司关于增加浙商银行股份有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2014-03-31
7	天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）2014年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2014-04-18
8	天弘基金管理有限公司关于公司	中国证券报、上海证券报、	2014-05-30

	注册资本及股权变更的公告	证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	
9	天弘基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2014-06-19
10	天弘基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件信息的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2014-06-26

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）的文件
- 2、天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）托管协议
- 4、中国证监会批准设立天弘基金管理有限公司的文件
- 5、天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

11.2 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

11.3 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
二〇一四年八月二十六日