

天治财富增长证券投资基金 2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:天治基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

重要提示:基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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责任。

基金产品概况:基金名称:天治财富增长基金;基金代码:150001;交易代码:150001;基金运作方式:契约型开放式;基金合同生效日:2004年6月29日;报告期末基金份额总额:363,687,823.01份

主要财务指标:单位:人民币元;1.本期已实现收益:7,831,358.15;2.本期利润:45,895,829.04;3.加权平均基金份额本期利润:0.1237;4.期末基金资产净值:288,581,231.34;5.期末基金份额净值:0.7935

基金净值表现:报告期:2010年7月1日至2010年9月30日;1.本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较;2.本报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金投资组合:报告期末按行业分类的股票投资组合;报告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

报告期末按品种分类的债券投资组合: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债券投资明细

注:本报告基金合同约定,本基金在资产配置中股票投资比例范围为基金资产净值的0-70%,债券投资比例范围为基金资产净值的20%-100%。

4.1 基金经理(或基金小组)简介

基金经理:姓名:曹晓;职务:基金经理;任职日期:2008-6-30;离任日期:-;证券从业年限:15;说明:经济学硕士,证券从业资格,基金从业资格

注:1.表内任职日期和离任日期为公司作出决定之日;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;

4.3 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为;

4.4 报告期内本基金投资流通受限资产的情况:报告期末,本基金持有处于转股期的可转换债券市值

5.1 报告期末基金资产组合情况

报告期末基金资产组合情况:序号:1;项目:权益投资;金额(元):181,809,067.60;占基金总资产的比例(%):

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合:代码:农林、牧、渔业;公允价值(元):5,944,500.00;占基金资产净值比例(%):

5.3 报告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

报告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:序号:1;股票代码:002080;股票名称:中材科技;数量(股):200,000;公允价值(元):10,376,000.00

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

报告期末按品种分类的债券投资组合:序号:1;债券品种:国债;公允价值(元):10,143,000.00;占基金资产净值比例(%):

5.5 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债券投资明细

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债券投资明细:序号:1;债券代码:080017;债券名称:08央行票据17;数量(张):500,000;公允价值(元):50,460,000.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.7 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权证投资明细

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库

5.8.3 其他资产构成

其他资产构成:序号:1;名称:存出保证金;金额(元):2,080,000.00

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金投资流通受限资产的情况:报告期末,本基金持有处于转股期的可转换债券市值

5.9.2 异常交易行为的专项说明

5.9.2.1 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为

5.9.3 异常交易行为的专项说明

5.9.3.1 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为

5.9.3.2 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为

天治创新先锋股票型证券投资基金 2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:天治基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

重要提示:基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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责任。

基金产品概况:基金名称:天治创新先锋股票;基金代码:350005;交易代码:350005;基金运作方式:契约型开放式;基金合同生效日:2008年5月8日;报告期末基金份额总额:169,647,593.64份

主要财务指标:单位:人民币元;1.本期已实现收益:1,088,182.13;2.本期利润:22,980,852.00;3.加权平均基金份额本期利润:0.3176;4.期末基金资产净值:243,345,534.38;5.期末基金份额净值:1.4344

基金净值表现:报告期:2010年7月1日至2010年9月30日;1.本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较;2.本报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金投资组合:报告期末按行业分类的股票投资组合;报告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

报告期末按品种分类的债券投资组合: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债券投资明细

注:本报告基金合同约定,本基金股票资产投资比例为基金资产的60%-95%,其中,股票资产的80%以上投资于本基金基金合同约定的股票、债券、货币类资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的5%-40%

4.1 基金经理(或基金小组)简介

基金经理:姓名:曹晓;职务:基金经理;任职日期:2008-6-30;离任日期:-;证券从业年限:15;说明:经济学硕士,证券从业资格,基金从业资格

注:1.表内任职日期和离任日期为公司作出决定之日;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;

4.3 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为;

5.1 报告期末基金资产组合情况

报告期末基金资产组合情况:序号:1;项目:权益投资;金额(元):2,782,662,669.56;占基金总资产的比例(%):

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合:代码:农林、牧、渔业;公允价值(元):40,290,000.00;占基金资产净值比例(%):

5.3 报告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

报告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:序号:1;股票代码:002088;股票名称:中材科技;数量(股):3,341,470;公允价值(元):173,355,463.60

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

报告期末按品种分类的债券投资组合:序号:1;债券品种:国债;公允价值(元):10,143,000.00;占基金资产净值比例(%):

5.5 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债券投资明细

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债券投资明细:序号:1;债券代码:122010;债券名称:08沪债;数量(张):100,000;公允价值(元):10,230,000.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.7 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权证投资明细

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库

5.8.3 其他资产构成

其他资产构成:序号:1;名称:存出保证金;金额(元):2,250,000.00

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金投资流通受限资产的情况:报告期末,本基金持有处于转股期的可转换债券市值

5.9.2 异常交易行为的专项说明

5.9.2.1 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为

5.9.3 异常交易行为的专项说明

5.9.3.1 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为

5.9.3.2 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为

天治核心成长股票型证券投资基金(LOF) 2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:天治基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

重要提示:基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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责任。

基金产品概况:基金名称:天治核心成长股票(LOF);基金代码:163503;交易代码:163503;基金运作方式:契约型上市开放式(LOF);基金合同生效日:2006年1月20日;报告期末基金份额总额:5,542,962,317.28份

主要财务指标:单位:人民币元;1.本期已实现收益:26,395,037.50;2.本期利润:590,615,162.39;3.加权平均基金份额本期利润:0.1046;4.期末基金资产净值:3,180,175,284.69;5.期末基金份额净值:0.5737

基金净值表现:报告期:2010年7月1日至2010年9月30日;1.本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较;2.本报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

4.1 基金经理(或基金小组)简介

基金经理:姓名:吴旻;职务:基金经理;任职日期:2008-4-11;离任日期:-;证券从业年限:11;说明:华东理工大学毕业,证券从业资格,11年从业经验

注:1.表内任职日期和离任日期为公司作出决定之日;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;

4.3 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为;

5.1 报告期末基金资产组合情况

报告期末基金资产组合情况:序号:1;项目:权益投资;金额(元):2,782,662,669.56;占基金总资产的比例(%):

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合:代码:农林、牧、渔业;公允价值(元):40,290,000.00;占基金资产净值比例(%):

5.3 报告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

报告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:序号:1;股票代码:002088;股票名称:中材科技;数量(股):3,341,470;公允价值(元):173,355,463.60

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

报告期末按品种分类的债券投资组合:序号:1;债券品种:国债;公允价值(元):10,143,000.00;占基金资产净值比例(%):

5.5 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债券投资明细

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债券投资明细:序号:1;债券代码:122010;债券名称:08沪债;数量(张):100,000;公允价值(元):10,230,000.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.7 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权证投资明细

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库

5.8.3 其他资产构成

其他资产构成:序号:1;名称:存出保证金;金额(元):2,250,000.00

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金投资流通受限资产的情况:报告期末,本基金持有处于转股期的可转换债券市值

5.9.2 异常交易行为的专项说明

5.9.2.1 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为

5.9.3 异常交易行为的专项说明

5.9.3.1 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为

5.9.3.2 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为

天治核心成长股票型证券投资基金(LOF) 2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:天治基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

重要提示:基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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责任。

基金产品概况:基金名称:天治核心成长股票(LOF);基金代码:163503;交易代码:163503;基金运作方式:契约型上市开放式(LOF);基金合同生效日:2006年1月20日;报告期末基金份额总额:5,542,962,317.28份

主要财务指标:单位:人民币元;1.本期已实现收益:26,395,037.50;2.本期利润:590,615,162.39;3.加权平均基金份额本期利润:0.1046;4.期末基金资产净值:3,180,175,284.69;5.期末基金份额净值:0.5737

基金净值表现:报告期:2010年7月1日至2010年9月30日;1.本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较;2.本报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

4.1 基金经理(或基金小组)简介

基金经理:姓名:吴旻;职务:基金经理;任职日期:2008-4-11;离任日期:-;证券从业年限:11;说明:华东理工大学毕业,证券从业资格,11年从业经验

注:1.表内任职日期和离任日期为公司作出决定之日;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;

4.3 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为;

5.1 报告期末基金资产组合情况

报告期末基金资产组合情况:序号:1;项目:权益投资;金额(元):2,782,662,669.56;占基金总资产的比例(%):

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合:代码:农林、牧、渔业;公允价值(元):40,290,000.00;占基金资产净值比例(%):

5.3 报告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

报告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:序号:1;股票代码:002088;股票名称:中材科技;数量(股):3,341,470;公允价值(元):173,355,463.60

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

报告期末按品种分类的债券投资组合:序号:1;债券品种:国债;公允价值(元):10,143,000.00;占基金资产净值比例(%):

5.5 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债券投资明细

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债券投资明细:序号:1;债券代码:122010;债券名称:08沪债;数量(张):100,000;公允价值(元):10,230,000.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.7 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权证投资明细

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库

5.8.3 其他资产构成

其他资产构成:序号:1;名称:存出保证金;金额(元):2,250,000.00

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金投资流通受限资产的情况:报告期末,本基金持有处于转股期的可转换债券市值

5.9.2 异常交易行为的专项说明

5.9.2.1 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为

5.9.3 异常交易行为的专项说明

5.9.3.1 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为

5.9.3.2 异常交易行为的专项说明:报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为