

基金管理人:天治基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

估值模型和估值结果进行论证审核,并签署最终意见。基金经理会参与估值,与金融工程小组一同根据估值模型、估值程序计算提供相关投资品种的公允价值进行估值处理。

7.4.1 期末买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with columns: 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(%)

注:表中"买入金额"按买入成交金额 成交单价乘以成交量 孰低,不考虑相关交易费用。

7.4.2 期末卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with columns: 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(%)

注:表中"卖出金额"按卖出成交金额 成交单价乘以成交量 孰低,不考虑相关交易费用。

2.1 基金基本情况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金管理人, 基金托管人, etc.

2.2 基金产品说明

投资目标:在灵活配置股票和债券资产的基础上,精选受益于重大人口趋势的行业中的领先企业,追求持续稳健的超额回报。

2.3 基金管理人

Table with columns: 姓名, 职务, 国籍, 任职日期, etc.

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 期间数据指标

Table with columns: 项目, 本报告期(2011年1月1日至2011年6月30日), 上年同期(2010年12月31日)

注:1、上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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

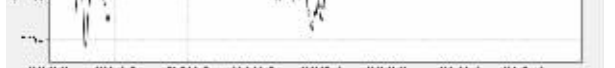
Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, etc.

注:1、自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满三年。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及其基金托管人

4.1.1 基金管理人及其基金托管人的简介
4.1.2 基金管理人及其基金托管人的业绩表现



注:按照本基金合同约定,本基金股票资产投资比例为基金资产的30%-80%,其中,股票资产的80%以上投资于受益于人口趋势的先进企业的领先企业。

4.2 基金经理

4.2.1 基金经理简介
4.2.2 基金经理从业经历

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.4.2 报告期内基金业绩表现

4.5 报告期内基金的投资组合

4.5.1 报告期内基金的投资组合
4.5.2 报告期内基金的投资组合

4.6 管理人对报告期内本基金净值变动情况的说明

4.6.1 报告期内本基金净值变动的说明
4.6.2 报告期内本基金净值变动的说明

4.7 报告期内基金的投资组合

4.7.1 报告期内基金的投资组合
4.7.2 报告期内基金的投资组合

4.8 报告期内基金的投资组合

4.8.1 报告期内基金的投资组合
4.8.2 报告期内基金的投资组合

4.9 报告期内基金的投资组合

4.9.1 报告期内基金的投资组合
4.9.2 报告期内基金的投资组合

4.10 报告期内基金的投资组合

4.10.1 报告期内基金的投资组合
4.10.2 报告期内基金的投资组合

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.2 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.3 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.4 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.5 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.6 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.7 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.8 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.9 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.10 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.11 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.12 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.13 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.14 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.15 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.16 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.17 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.18 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.19 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.20 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.21 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.22 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.23 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.24 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.25 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.26 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.27 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.28 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.29 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.30 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.31 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.32 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.33 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.34 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.35 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.36 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.37 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.38 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.39 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.40 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.41 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.42 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

5.43 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.6 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

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.8 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

Table with columns: 序号, 名称, 金额

7.9 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.10 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

9 投资组合公允价值变动

Table with columns: 项目, 持有公允价值(元), 占基金总资产比例

10 重大事件揭示

10.1 基金经理变更
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门重大变动
10.3 涉及基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼事项
10.4 基金投资策略的改变
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.3 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with columns: 券商名称, 成交金额, 占当期股票成交金额的比例, 佣金, 占当期佣金总额的比例

7.1 期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 类别, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金总资产的比例(%)

注:投资者除了本报告期末基金投资的有价证券明细,还应阅读发表于公司网站www.chinamut.com.cn上的半年度报告全文。