

基金管理人:天治基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年三月二十六日

天治财富增长证券投资基金

2011年度 报告摘要

2011年12月31日

2.1基金基本情况
基金简称:天治财富增长混合
基金代码:350001
交易代码:350001

2.2基金产品说明
在确保基金份额净值不低于基金建定的动态资产保障线的基础上,谋求基金资产的长期稳定增值,并适当参与股票投资,以投资组合保险机制、VaR Value at Risk 技术为核心工具,对风险来源(股票与低风险资产)的

2.3基金管理人及基金托管人
基金管理人:天治基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

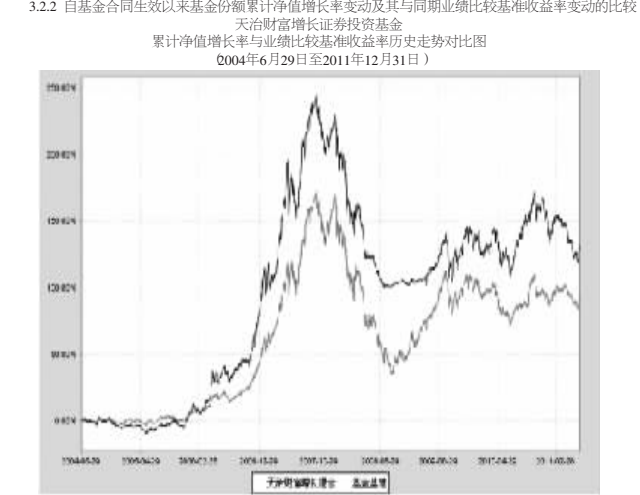
3.1主要会计数据和财务指标
3.1.1期间数据和指标
2011年 2010年 2009年

Table with 5 columns: 指标, 2011年, 2010年, 2009年, 单位:人民币元. Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, etc.

3.1.2期末数据和指标
2011年末 2010年末 2009年末

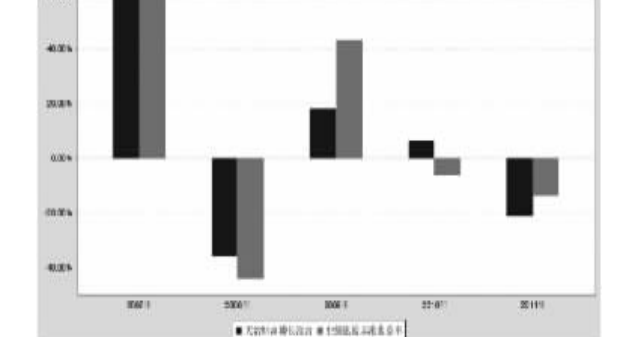
Table with 5 columns: 指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末, 单位:人民币元. Rows include 期末基金份额总额, 期末可供分配基金份额总额, etc.

3.2基金合同生效以来基金业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较
3.2.1基金合同生效以来基金业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较

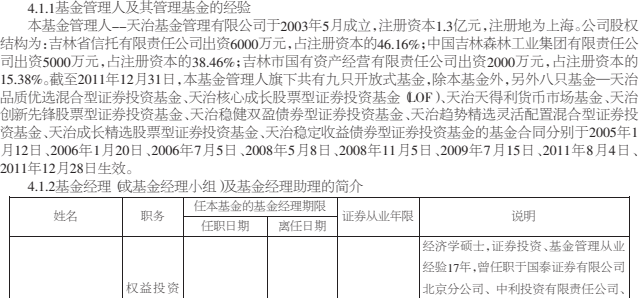


按照本基金合同约定,本基金在资产配置中股票投资比例范围为基金资产净值的30%-70%,债券投资比例范围为基金资产净值的20%-100%.

3.2.2过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3过去三年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



4.1基金管理人及其管理基金的经验
4.1.1基金管理人:天治基金管理有限公司于2003年5月成立,注册资本1.5亿元,注册地为上海.

4.2基金管理人及其管理基金的经验
4.2.1基金管理人:天治基金管理有限公司于2003年5月成立,注册资本1.5亿元,注册地为上海.

4.3基金管理人及其管理基金的经验
4.3.1基金管理人:天治基金管理有限公司于2003年5月成立,注册资本1.5亿元,注册地为上海.

4.4基金管理人及其管理基金的经验
4.4.1基金管理人:天治基金管理有限公司于2003年5月成立,注册资本1.5亿元,注册地为上海.

2011年度 报告摘要
基金管理人:天治基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年三月二十六日

2.1基金基本情况
基金简称:天治财富增长混合
基金代码:350001
交易代码:350001

2.2基金产品说明
在确保基金份额净值不低于基金建定的动态资产保障线的基础上,谋求基金资产的长期稳定增值,并适当参与股票投资,以投资组合保险机制、VaR Value at Risk 技术为核心工具,对风险来源(股票与低风险资产)的

2.3基金管理人及基金托管人
基金管理人:天治基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

3.1主要会计数据和财务指标
3.1.1期间数据和指标
2011年 2010年 2009年

Table with 5 columns: 指标, 2011年, 2010年, 2009年, 单位:人民币元. Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, etc.

3.1.2期末数据和指标
2011年末 2010年末 2009年末

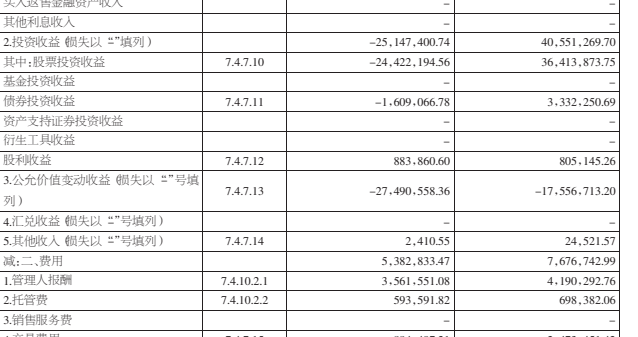
Table with 5 columns: 指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末, 单位:人民币元. Rows include 期末基金份额总额, 期末可供分配基金份额总额, etc.

3.2基金合同生效以来基金业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较
3.2.1基金合同生效以来基金业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较

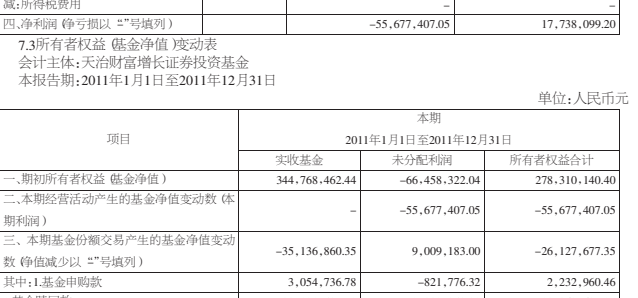


按照本基金合同约定,本基金在资产配置中股票投资比例范围为基金资产净值的30%-70%,债券投资比例范围为基金资产净值的20%-100%.

3.2.2过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3过去三年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



4.1基金管理人及其管理基金的经验
4.1.1基金管理人:天治基金管理有限公司于2003年5月成立,注册资本1.5亿元,注册地为上海.

4.2基金管理人及其管理基金的经验
4.2.1基金管理人:天治基金管理有限公司于2003年5月成立,注册资本1.5亿元,注册地为上海.

4.3基金管理人及其管理基金的经验
4.3.1基金管理人:天治基金管理有限公司于2003年5月成立,注册资本1.5亿元,注册地为上海.

4.4基金管理人及其管理基金的经验
4.4.1基金管理人:天治基金管理有限公司于2003年5月成立,注册资本1.5亿元,注册地为上海.

952,004,756.57份基金份额。本基金为契约开放式,存续期限不定,本基金的基金管理人及注册登记机构为天治财富管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

7.4.2信息披露的编制基础
本财务报表按照财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则,其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国注册会计师协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于进一步加强证券投资基金信息披露工作的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号—年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号—会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL编报规则第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

7.4.3遵循的企业会计准则及其他相关规定的声明
本财务报表符合企业会计准则的相关规定,真实、完整地反映了本基金2011年12月31日的财务状况以及2011年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4本报告期采用的会计政策、会计估计与上一会计年度保持一致
7.4.5本报告期采用的会计政策、会计估计与上一会计年度保持一致。

7.4.6本报告期无重大会计差错的内容和更正情况。
7.4.7关联交易
经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税率,由原先的3‰调整为1‰;

7.4.8关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.1关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.2关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.3关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.4关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.5关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.6关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.7关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.8关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.9关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.10关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.11关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.12关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.13关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.14关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.15关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.16关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.17关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.18关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.19关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.20关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.21关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.22关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.23关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.24关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.25关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.26关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

7.4.8.27关联方关系
关联方名称 与本基金的关系
天治基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

8.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

Table with 5 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)乘以成交量(成交数量)计算,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

Table with 5 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)乘以成交量(成交数量)计算,不考虑相关交易费用。

8.4.3买入股票的成本/减值准备

Table with 2 columns: 买入股票的成本/减值准备, 金额

注:表中“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入成交金额(成交单)乘以成交量(成交数量)计算,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

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 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(%)

8.7期末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

8.8期末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

8.9投资组合报告附注
8.9.1基金投资的前十名股票中,没有投资在报告期内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、处罚的股票。

8.9.2基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.9.3期末其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

8.9.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

9.1期末基金资产持有人户数及持有人结构

Table with 2 columns: 序号, 项目, 持有份额(份), 占基金总份额比例

9.10开放式基金资产变动

Table with 2 columns: 项目, 持有份额(份), 占基金总份额比例

9.11重大事件揭示
9.11.1基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

9.11.2基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内,基金托管人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

9.11.3基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内,基金托管人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

9.11.4基金投资策略的改变
报告期内,本基金的投资策略未发生改变。

9.11.5基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内,基金托管人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

9.11.6基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内,基金托管人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

9.11.7基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内,基金托管人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

9.11.8基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内,基金托管人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

9.11.9基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内,基金托管人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

9.11.10基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内,基金托管人、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。