



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

1 重要提示及目录
1.1 重要提示
基金管理人、董事、监事、高级管理人员...

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失...

基金的投资业绩并不代表其未来表现。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。

本报告中财务数据摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。本报告中财务数据未经审计。

本报告自2012年1月1日起至6月30日止。
2 基金简介
2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, code, type, and manager info.

2.2 基金产品说明
在确保基金份额净值不低于本基金建立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。

Table with 2 columns: Item and Value. Includes investment strategy, risk control, and management info.

Table with 2 columns: Item and Value. Includes website and contact information.

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

Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial metrics for the reporting period.

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。

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(即期末余额,不足当期发生数)。

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

Table comparing fund performance with benchmark over various periods.

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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

Table showing cumulative performance trends since inception.

注:按照本基金合同规定,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 基金管理人及基金经理情况
4.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人-天治基金管理有限公司于2003年5月成立,注册资本1.6亿元,注册地为上海。公司股权结构为:吉林信托有限责任公司出资7800万元,占注册资本的46.75%;中国吉林森林工业集团有限责任公司出资6200万元,占注册资本的38.75%;吉林市国有资产经营有限责任公司出资2000万元,占注册资本的12.50%。

截至2012年6月30日,本基金管理人旗下共有九只开放式基金,除本基金外,另外八只基金-天治启明星混合型证券投资基金、天治核心成长股票型证券投资基金(LOF)、天治天得利货币市场基金、天治创新先锋股票型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、天治成长精选股票型证券投资基金、天治稳定收益债券型证券投资基金的基金合同分别于2005年1月12日、2006年1月20日、2006年7月5日、2008年5月8日、2008年11月5日、2009年7月15日、2011年8月4日、2011年12月28日生效。

4.1.2 基金经理 钱基理 基金经理助理 简介

Table with 5 columns: Name, Position, Start Date, End Date, Remarks.

注:1、表内的任职日期和聘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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 基金管理人报告期内基金投资运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《天治财富增长证券投资基金合同》、《天治财富增长证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善法律法规体系和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 基金管理人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

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易制度》、《研究交易监控与报告制度》。本基金管理人公平交易体系全面监控、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各个环节,并通过明确授权投资决策计划,建立统一研究报告管理平台,分层分类建立全公司及各投资组合的投资对备选库和交易对手备选库,应用投资管理系统公平交易相关程序,定期对不同投资组合收益差异、交易价差、成交量事后量化分析评估等一系列措施切实落实各项公平交易制度。

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合均未发生交易所公开竞价同日反向交易的情形。

4.4 基金管理人报告期内基金投资运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《天治财富增长证券投资基金合同》、《天治财富增长证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善法律法规体系和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 基金管理人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

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易制度》、《研究交易监控与报告制度》。本基金管理人公平交易体系全面监控、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各个环节,并通过明确授权投资决策计划,建立统一研究报告管理平台,分层分类建立全公司及各投资组合的投资对备选库和交易对手备选库,应用投资管理系统公平交易相关程序,定期对不同投资组合收益差异、交易价差、成交量事后量化分析评估等一系列措施切实落实各项公平交易制度。

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合均未发生交易所公开竞价同日反向交易的情形。

4.4 基金管理人报告期内基金投资运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《天治财富增长证券投资基金合同》、《天治财富增长证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善法律法规体系和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 基金管理人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

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易制度》、《研究交易监控与报告制度》。本基金管理人公平交易体系全面监控、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各个环节,并通过明确授权投资决策计划,建立统一研究报告管理平台,分层分类建立全公司及各投资组合的投资对备选库和交易对手备选库,应用投资管理系统公平交易相关程序,定期对不同投资组合收益差异、交易价差、成交量事后量化分析评估等一系列措施切实落实各项公平交易制度。

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合均未发生交易所公开竞价同日反向交易的情形。

4.4 基金管理人报告期内基金投资运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《天治财富增长证券投资基金合同》、《天治财富增长证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善法律法规体系和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 基金管理人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

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易制度》、《研究交易监控与报告制度》。本基金管理人公平交易体系全面监控、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各个环节,并通过明确授权投资决策计划,建立统一研究报告管理平台,分层分类建立全公司及各投资组合的投资对备选库和交易对手备选库,应用投资管理系统公平交易相关程序,定期对不同投资组合收益差异、交易价差、成交量事后量化分析评估等一系列措施切实落实各项公平交易制度。

天治财富增长证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

本基金管理人的基金估值和会计核算由基金结算部负责,根据相关法律法规规定、基金合同的约定,制定了内部控制措施,对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制。基金结算部人员均具备基金从业资格和会计专业工作经历,为确保基金资产估值的公平、合理、合规,有效维护投资者的利益,本基金管理人设立了天治基金管理有限公司估值委员会(以下简称“估值委员会”),制定了有关议事规则。估值委员会成员包括公司投资决策委员会成员、负责基金结算的管理层、监察稽核部总监、金融工程小组等,所有相关人员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对于投资管理以及金融工程小组提交的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以进行估值处理,将估值结果提交公司估值委员会。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,当存在异议时,托管银行有责任要求基金管理公司做出解释,通过积极沟通达成一致意见。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。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
本基金报告期内未分配利润。根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况,不需分配利润。

5 托管人报告
报告期内,本基金的托管人遵守诚信原则,按照相关法律法规规定、基金合同的约定,履行了托管人职责。

5.1 报告期内,本基金的托管人遵守诚信原则,按照相关法律法规规定、基金合同的约定,履行了托管人职责。

本报告期内,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“本托管人”)在对天治财富增长证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责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,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同、托管协议的约定,对天治财富增长证券投资基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回的价格、费用开支以及基金费用开支等方面进行了认真复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本报告期内,由天治基金管理有限公司编制的本报告期内财务指标、净值表现、收益分配报告、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务报表(未经审计)
6.1 资产负债表
会计主体:天治财富增长证券投资基金
报告截止日:2012年6月30日

Balance Sheet table showing assets and liabilities as of 2012/6/30 and 2011/12/31.

注:基金管理人按照前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=EoLx50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2 关联方关系
6.4.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
上海浦东发展银行股份有限公司 基金托管人、基金代销机构

6.4.3.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.3.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.3.2 关联方交易
6.4.3.1 基金管理人
单位:人民币元

Table showing management fees and other expenses for the reporting period.

注:基金管理人按照前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=EoLx50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2 关联方关系
6.4.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
上海浦东发展银行股份有限公司 基金托管人、基金代销机构

6.4.3.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.3.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.3.2 关联方交易
6.4.3.1 基金管理人
单位:人民币元

Table showing management fees and other expenses for the reporting period.

注:基金管理人按照前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=EoLx50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2 关联方关系
6.4.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
上海浦东发展银行股份有限公司 基金托管人、基金代销机构

6.4.3.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.3.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.3.2 关联方交易
6.4.3.1 基金管理人
单位:人民币元

Table showing management fees and other expenses for the reporting period.

注:基金管理人按照前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=EoLx50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2 关联方关系
6.4.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
上海浦东发展银行股份有限公司 基金托管人、基金代销机构

6.4.3.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.3.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.3.2 关联方交易
6.4.3.1 基金管理人
单位:人民币元

Table showing management fees and other expenses for the reporting period.

注:基金管理人按照前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=EoLx50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2 关联方关系
6.4.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
上海浦东发展银行股份有限公司 基金托管人、基金代销机构

6.4.3.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.3.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.3.2 关联方交易
6.4.3.1 基金管理人
单位:人民币元

Table showing management fees and other expenses for the reporting period.

注:基金管理人按照前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=EoLx50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2 关联方关系
6.4.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
上海浦东发展银行股份有限公司 基金托管人、基金代销机构

6.4.3.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.3.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.3.2 关联方交易
6.4.3.1 基金管理人
单位:人民币元

Table showing management fees and other expenses for the reporting period.

注:基金管理人按照前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=EoLx50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2 关联方关系
6.4.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
上海浦东发展银行股份有限公司 基金托管人、基金代销机构

6.4.3.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.3.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.3.2 关联方交易
6.4.3.1 基金管理人
单位:人民币元

Table showing management fees and other expenses for the reporting period.

注:基金管理人按照前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=EoLx50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2 关联方关系
6.4.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
上海浦东发展银行股份有限公司 基金托管人、基金代销机构

6.4.3.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.3.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.3.2 关联方交易
6.4.3.1 基金管理人
单位:人民币元

Table showing management fees and other expenses for the reporting period.

注:基金管理人按照前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=EoLx50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2 关联方关系
6.4.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
上海浦东发展银行股份有限公司 基金托管人、基金代销机构

6.4.3.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.3.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.3.2 关联方交易
6.4.3.1 基金管理人
单位:人民币元

Table showing management fees and other expenses for the reporting period.

注:基金管理人按照前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=EoLx50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2 关联方关系
6.4.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
上海浦东发展银行股份有限公司 基金托管人、基金代销机构

6.4.3.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.3.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.3.2 关联方交易
6.4.3.1 基金管理人
单位:人民币元

Table showing management fees and other expenses for the reporting period.

注:基金管理人按照前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=EoLx50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2 关联方关系
6.4.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
上海浦东发展银行股份有限公司 基金托管人、基金代销机构

6.4.3.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.3.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.3.2 关联方交易
6.4.3.1 基金管理人
单位:人民币元

Table showing management fees and other expenses for the reporting period.

注:基金管理人按照前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=EoLx50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2 关联方关系
6.4.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
上海浦东发展银行股份有限公司 基金托管人、基金代销机构

Table showing top 20 stock holdings of the fund as of 2012/6/30.

注:表中“买入金额/卖出成交金额”按成交单均价以成交数量 填写,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

Table showing top 20 stock sell-off details for the reporting period.

注:表中“买入金额/卖出成交金额”按成交单均价以成交数量 填写,不考虑相关交易费用。
7.4.3 买入金额/卖出成交金额 按成交单均价以成交数量 填写,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
金额单位:人民币元

Table showing bond portfolio composition as of 2012/6/30.

注:表中“买入金额/卖出成交金额”按成交单均价以成交数量 填写,不考虑相关交易费用。

7.5 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 showing top 5 bond holdings by fair value as of 2012/6/30.

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 showing top 5 bond holdings by fair value as of 2012/6/30.

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 showing top 10 asset-backed securities as of 2012/6/30.

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

Table showing top 10 warrants as of 2012/6/30.

7.9 投资组合报告附注
7.9.1 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

7.9.2 本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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

Table showing other assets as of 2012/6/30.

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table showing restricted stock holdings as of 2012/6/30.

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

Table showing shareholder structure as of 2012/6/30.

8.2 期末本基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table showing staff holdings as of 2012/6/30.

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有该基金份额总量的数量区间为0;
2、该只基金的基金经理持有该基金份额总量的数量区间为0。

9 开放式基金份额变动

Table showing fund share changes as of 2012/6/30.

10 重大事件揭示
10.1 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

10.3 基金经理人鞠传周先生为天治财富增长证券投资基金的基金经理,谢激先生不再管理该基金,上述事项已按规定在中国证券投资基金业协会网站、并和中国证监会上海监管局备案。基金管理人于2012年6月30日在指定媒体及公司网站上刊登了《天治财富增长证券投资基金基金经理变更公告》。

10.4 基金投资范围发生变更

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

Table showing broker usage as of 2012/6/30.

注:1、上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。