天治财富增长证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年12月31日

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:二〇一四年三月二十七日

§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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月26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、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天治财富增长混合
基金主代码	350001
交易代码	350001
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
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
报告期末基金份额总额	245,143,619.12份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
投资策略	本基金建立随时间推移呈非负增长的动态资产保障线,以投资组合保险机制、VaR(Value at Risk)技术为核心工具,对风险性资产(股票)与低风险资产(债券)的投资比例进行动态调整,并结合下方风险来源分析,对基金的各类资产实施全流程的风险预算管理,力争使基金份额净值高于动态资产保障线水平。在风险可控的基础上,本基金通过积极投资,谋求最大限度地实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中信标普300指数x40%+中信标普全债指数x60%。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中风险较低、收益稳健的基金品种。

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		天治基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张丽红	廖原
	联系电话	021-60371155	021-61618888
	电子邮箱	zhanglh@chinanature.com.cn	liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		400-098-4800(免长途通话费用).021-60374800	95528
传真		021-60374934	021-63602540

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.chinanature.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	49,748,874.04	-27,300,398.95	-28,186,848.69
本期利润	33,465,851.45	10,613,428.27	-55,677,407.05
加权平均基金份额本期利润	0.1258	0.0353	-0.1713
本期基金份额净值增长率	18.42%	5.99%	-21.38%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2035	-0.3820	-0.3654
期末基金资产净值	195,245,620.18	191,648,741.61	196,505,056.00
期末基金份额净值	0.7965	0.6726	0.6346

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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

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
过去三个月	0.14%	1.16%	-2.20%	0.57%	2.34%	0.59%
过去六个月	11.38%	1.18%	2.96%	0.63%	8.42%	0.55%
过去一年	18.42%	1.29%	-1.93%	0.69%	20.35%	0.60%
过去三年	-1.33%	1.08%	-10.35%	0.69%	9.02%	0.39%
过去五年	23.99%	1.07%	20.76%	0.85%	3.23%	0.22%
自基金合同生效起至今	152.76%	1.09%	73.74%	1.01%	79.02%	0.08%

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

天治财富增长证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

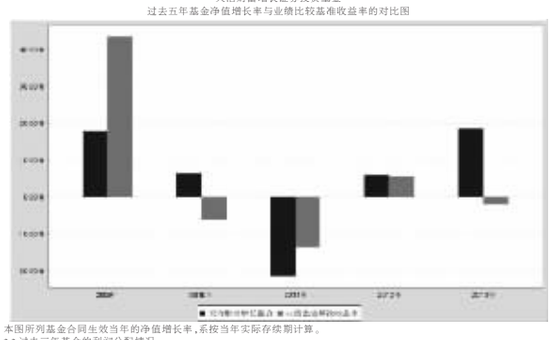
(2004年6月29日至2013年12月31日)

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%。本基金自2004年6月29日基金合同生效日起六个月内,达到了本基金合同第18条规定的投资比例限制。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天治财富增长证券投资基金

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



本图所列基金合同生效当年的净值增长率,系按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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

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:吉林省信托有限责任公司出资9800万元,占注册资本的61.25%;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%。截至2013年12月31日,本基金管理人旗下共有十只开放式基金,除本基金外,另外九只基金—天治品质优选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、天治稳健双益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、天治可转债增强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、2013年6月4日生效。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周雪军	本基金的基金经理。	2012-06-29	-	5	金融学专业硕士研究生,具有基金从业资格,证券从业经验5年,历任北京金融街股份有限公司职员,本公司首席研究员,现任本基金的基金经理。

注:1.表内的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。

4.2 管理人对报告期内本基金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、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产,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人治理结构和内部控制制度,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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定制定了《公平交易制度》。公司公平交易体系涵盖研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,各环节公平措施简要如下:

公司的内外部报告均通过统一的研究管理平台发布,所有的研究员和投资组合经理均有权通过该平台查看公司所有内外部研究报告。

投资组合经理在授权权限范围内做出投资决策,并负责投资决策的具体实施。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。同时,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行集中交易制度,并在交易系统中设置公平交易功能并严格执行,即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,交易系统将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合。

公司对银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易,保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配