

天治财富增长证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3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:二〇一四年四月十九日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金管理人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

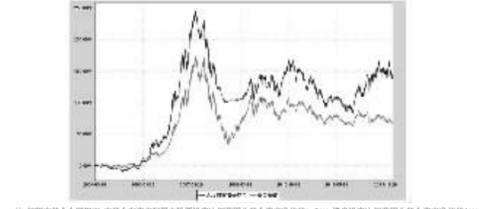
Table with 2 columns: 基金名称, 天治财富增长混合; 基金代码, 350002; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2004年6月29日; 报告期末基金份额总额, 204,218,151.15份; 投资目标, 在有效控制风险的前提下,追求中长期稳定且超越业绩比较基准的投资回报;

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年1月1日至2014年3月31日); 1.本期已实现收益, -9,833,206.76; 2.本期利润, -9,855,140.22; 3.加权平均基金份额本期利润, -0.0411; 4.期末基金资产净值, 176,764,988.18; 5.期末基金份额净值, 0.7547

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。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准差率④, ①-③, ②-③; 过去三个月, -3.25%, 1.24%, -2.77%, 0.57%, -2.48%, 0.67%

注:按照本基金合同规定,本基金资产配置中股票投资比例范围为基金资产净值的70%-76%,债券投资比例范围为基金资产净值的20%-100%,本基金自2004年4月29日基金合同生效日起六个月内,达到本基金合同第17条规定的投资比例限制。



天治财富增长证券投资基金 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2004年4月29日至2014年3月31日)

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明; 周雪军, 基金经理, 2012-6-29, 6, 金融学专业硕士研究生,具有基金从业资格,证券从业资格,曾任北京嘉实基金管理有限公司,本公司基金经理,现任天治财富增长证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.3 公平交易专项说明

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.5 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.6 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.7 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.8 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.9 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.10 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.11 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.12 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.13 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.14 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.15 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.16 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.17 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.18 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

4.19 报告期内基金的投资组合报告

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》、《异常交易监控与报告制度》,本基金管理人公平交易系统建设情况、研究报告、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,并通过监控与报告程序,建立统一的投资组合收益差异、交易分析、成交事项后量化分析评估等一系列措施,切实落实公平交易制度。

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); A 农林牧渔, --; B 采矿业, --; C 制造业, 70,263,142.67, 39.76; D 电力、热力、燃气及生产供应业, --; E 建筑业, 17,103,133.76, 9.27; F 批发和零售业, --; G 交通运输、仓储和邮政业, --; H 住宿和餐饮业, --; I 信息传输、软件和信息技术服务业, --; J 金融业, --; K 房地产业, 14,923,200.00, 8.45; L 租赁和商务服务业, --; M 科学研究和技术服务业, 4,668,872.42, 2.61; N 水利、环境和公共设施管理业, --; O 居民服务、修理和其他服务业, --; P 教育, --; Q 卫生和社会工作, --; R 文化、体育和娱乐业, --; S 综合, --; 合计, 110,418,448.85, 62.47

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1 002236 大华股份, 288,689, 8,867,848.51, 4.42; 2 600448 保利地产, 780,000, 5,935,800.00, 3.36; 3 000002 万科A, 700,000, 5,643,000.00, 3.20; 4 603008 碧水源, 522,000, 5,387,000.00, 3.05; 5 002085 万丰能源, 275,350, 5,358,311.00, 3.03; 6 002415 华鲁恒升, 300,000, 5,225,000.00, 2.96; 7 110063 建 业 中 国 信 托, 440,000, 4,902,000.00, 2.77; 8 000651 格力电器, 170,000, 4,750,000.00, 2.69; 9 002669 西水股份, 329,214, 4,618,722.43, 2.61; 10 002375 亚夏集团, 183,528, 4,457,333.76, 2.52

5.4 报告期末按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(元), 占基金资产净值比例(%); 1 国债券, 23,257,938.90, 13.16; 2 央行票据, --; 3 金融债券, 19,980,000.00, 11.30; 其中:政策性金融债, 19,980,000.00, 11.30; 4 企业债券, --; 5 企业短期融资券, --; 6 中期票据, --; 7 可转债, 20,137,079.90, 11.39; 8 其他, --; 9 合计, 63,375,017.80, 35.85

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1 010107 21国债07, 233,490, 23,257,938.90, 13.16; 2 130227 13国债27, 280,000, 19,980,000.00, 11.30; 3 110063 建 业 中 国 信 托, 440,000, 4,902,000.00, 2.77; 4 113005 平安转债, 98,270, 9,713,989.50, 5.56

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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

5.9.1 报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.12 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有期权。

5.13 其他金融资产投资情况

本基金本报告期末未持有其他金融资产。

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期初基金份额总额, 245,143,619.12; 报告期内基金申购份额, 62,373,996.90; 报告期内基金赎回份额, 11,287,298.99; 报告期内基金拆分变动额, --; 报告期末基金份额总额, 234,218,151.15

6.1 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.2 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.3 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.4 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.5 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.6 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.7 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.8 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.9 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.10 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.11 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.12 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.13 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.14 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.15 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.16 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.17 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.18 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.19 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.20 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.21 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

6.22 基金资产净值

报告期末,基金管理人运用固有资产申购、赎回或买卖本基金。

天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:天治基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月十九日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金管理人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

Table with 2 columns: 基金名称, 天治趋势精选混合; 基金代码, 350007; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2009年7月15日; 报告期末基金份额总额, 87,233,558.00份; 投资目标, 在有效控制风险和保持资产流动性的基础上,精选受益于中长期趋势的资产进行投资,追求长期稳定的投资回报;

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年1月1日至2014年3月31日); 1.本期已实现收益, -2,647,450.47; 2.本期利润, -2,968,390.91; 3.加权平均基金份额本期利润, -0.0366; 4.期末基金资产净值, 31,562,062.46; 5.期末基金份额净值, 0.382

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。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准差率④, ①-③, ②-③; 过去三个月, -8.51%, 1.31%, -3.14%, 0.66%, -5.37%, 0.65%

注:按照本基金合同规定,本基金资产配置中股票投资比例为基金资产净值的30%-80%,其中,股票投资的30%以上投资于受益于中长期趋势的优质行业中的现金类资产、债券、货币市场基金以及法律法规允许范围内其他金融工具;本基金自2009年7月15日基金合同生效日起六个月内,达到了本基金合同第12条规定的投资比例限制。

3.2 本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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1 002236 大华股份, 35,000, 1,100,000.00, 3.49; 2 600448 保利地产, 132,000, 1,004,520.00, 3.19; 3 600966 新城控股, 78,000, 999,960.00, 3.17; 4 002482 广田股份, 63,000, 956,160.00, 3.06; 5 002275 赛象股份, 39,000, 952,800.00, 3.02; 6 603008 碧水源, 91,000, 939,120.00, 2.98; 7 000961 东 阿 药 业, 115,200, 913,800.00, 2.90; 8 000002 万科A, 110,000, 889,500.00, 2.82; 9 002415 华鲁恒兴, 50,000, 872,500.00, 2.77; 10 600835 西南证券, 44,000, 846,500.00, 2.69

3.3 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(元), 占基金资产净值比例(%); 1 113005 平安转债, 35,000, 3,459,750.00, 10.98; 2 113003 嘉 工 转 债, 26,900, 2,815,344.00, 8.94

3.4 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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

3.5 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贵金属投资明细

本基金本报告期末持有贵金属。

3.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末持有权证。

3.7 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

3.7.1 报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

3.8 报告期末本基金投资的国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

3.9 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

3.9.1 报告期内本基金投资的期权持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有期权。

3.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

3.11 报告期末本基金投资的股票期权持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股票期权。

3.12 报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证。

3.13 报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证。

3.14 报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证。

3.15 报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证。

3.16 报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证。

3.17 报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证。

3.18 报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证。

3.19 报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证。

3.20 报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证。

3.21 报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证。

3.22 报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证。

3.23 报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证