

基金管理人:天治基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司 送出日期:2014年8月26日

§ 1 重要提示

1.1 里安妮小 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、误导性陈述或重大溃漏,并对其内容的真实性、准确性 基金管理人的董事会、董事你此本报告所敬资料个存在能限过载、误导性除运改重大遗漏,开对其内容的真实性、准确性 有完整性并且个别及走都的法律责任。本年中度报告已经一分之一以上独立董事客字同意,并由董事长客受。 基金托管人交通银行银份有限公司根据本基金合同规定,于 2014年8月25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骸记载、误导性除还或者重大遗漏。 基金管理人求诺以该求任用、勤龄尽劳的原则管置张臣用基金资产但不识基金一定盈利。 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

本半年度报告摘要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。 本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014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	
基金简称	天治核心成长股票 (LOF)
场内简称	天治核心
基金主代码	163503
交易代码	163503
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2006年1月20日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,737,536,481.19 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007-07-30

风险收益特征	本基金为具有中等风险、中高收益的股票型基金,风险收益特征介于 大盘平衡型基金和小盘成长型基金之间。
业绩比较基准	富时中国 A 全指×75%+富时中国国债指数×25%。
投資策略	本基金以股票品种为主要投资标的,以 核心_卫星"策略作为股票投资的总体策略。核心_卫星"额格指特股票资产分为核心组合和卫星给,核心与通过跟踪指数进行被动投资,控制投资结合相对于市场的风险;卫星组合通过优选股票进行主动投资,追求超越市场平均水平的收益。本基金的核心组合用于跟踪大型公司股票指数 傷时中国 A201 指数,卫星组合用于优连中小型成长公司股票。
投资目标	通过将部分资产投资于品质优良、成长潜力高于平均水平的中小型上市公司股票,并将部分资产用于复制大型上市公司股票,指数 G时中国 A200 指数 的业绩表现,在控制相对市场风险的前提下,追求中长期的资本增值。

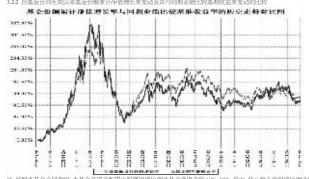
2.3 基金管理人	中基金托管人		
项目		基金管理人	基金托管人
名称 天		天治基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
	姓名	张丽红	王涛
信息披露负责人	联系电话	021-60371155	95559
	电子邮箱	zhanglh@chinanature.com.cn	t_wang@bankcomm.com
客户服务电话		400-098-4800	95559
传真		021-60374934	021-62701216
2.4 信息披露方式	C		

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-97,805,909.96
本期利润	-319,198,296.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0833
本期基金份额净值增长率	-14.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0840
期末基金资产净值	1,878,997,246.17
期末基金份额净值	0.5027

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

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
过去一个月	2.95%	0.88%	1.09%	0.62%	1.86%	0.26%
过去三个月	1.02%	0.91%	1.41%	0.68%	-0.39%	0.23%
过去六个月	-14.13%	1.17%	-1.67%	0.81%	-12.46%	0.36%
过去一年	-6.21%	1.23%	5.57%	0.89%	-11.78%	0.34%
过去三年	-10.41%	1.19%	-15.40%	0.99%	4.99%	0.20%
自基金合同生效 起至今	116.43%	1.56%	125.98%	1.41%	-9.55%	0.15%



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为基金净资产的 60%—95%,其中,核心组合的投资比例为股票资产净值的 53%—65%,卫星组合的投资比例为股票等产增值的 53%—65%,卫星组合的投资比例为股票等产增值的 53%—65%,卫星组合的投资比例为股票等产增 05%—56%,本基金自 2006 年 1 月 20 日基金合同生效日起六及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具不低于基金净资产的 5%。本基金自 2006 年 1 月 20 日基金合同生效日起六 个月内, 达到了本基金合同第 17 条规定的投资比例限制 § 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1 基金管理人及特理基金的经验
本基金管理人。一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
名信托有限责任公司出资 9000 万元,注注册资本的 6.125%。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 2014 年 6 月 30 日,本基金管理人旗下共有十只开放式基金、除本基金外,另外九只基金一天治财富增长证
条投资基金、无治品届优选混合型证券投资基金、无治元得利货币市场基金、无治创新先锋就票型证券投资基金、无治稳能及
盈债券型证券投资基金、无治高的债金量证券投资基金、无治元和长精造是票型证券投资基金、无治稳定收益债券型证券投资基金、无治的转储增益债券型证券投资基金、无治稳定收益债券型证券投资基金。无治有能价增强债券型证券投资基金。无治和长精业债金。 15 日、2008 年 5 月 8 日、2008 年 1 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。
4.12 基金经理 或基金经理外组 及基金经理购面价

姓名	职务	仕本基金的基金经理 切埋 期 限		证券从业年 限	说明	
		任职日期	离任日期	PIR		
秦海燕	本基金的基金经 理、天治品质优 选混合型证券投 资基金基金经 理。			8	理学硕士研究生,具有基金从业资格。 2006 年 6 月加入天治基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理,现任 本基金的基金经理、天治品质优选混合型 证券投资基金的基金经理。	
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。 42 管理人对指告期内本基金管建填产信息区的词 报告期外。本基金管理人严格控照《证券经资基金法》和其他相关法律注册的规定以及(天治核心或长股票型证券投资基金(LOF)基金合同)、(天治核心或长股票型证券投资基金(LOF)指募说明书)的约定本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金制产、为基金份额所有人成果利益。本基金管理人通过不断完整法人治理结构和均能控制制度、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

的各个环节,并通过明确投资权限划分,建立统一研究报告管理平台、分层次建立适用全公司及各投资组合的投资对象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率差异、交易价差、成交量率后量化分 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。

报告期内。本基金管理人整体公平交易制度执行范良县并未发现有违背公平交易的相关信息。 4.3.2 常交易行为的专项识明 招告期内。本基金管理人管理的所有投资组合未发生交易所公开竞价目日反向交易的情形,未发生所有投资组合参与的 交易所公开竞价间日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情形。 报告期内。本基金管理人未发现异常交易行为。 4.4 管理人方报告期内基金投资家联和证债券表现的说明 2.4.1 报告期内基金投资家联和运价分析。 2014年上半年,资本市场的主要指数涨跌情况,上证综指 - 3.2%,沪原 300 指数 - 7.08%,中小板 - 3.72%。创业板 7.60%,其 中上证综指的波动物的更新版。— 学度市场分化特别严重、以计算机、新能源等为首的一些行业、特别是创业板的股票。 邮级大、主题投资机会明显,而 2013 年涨磁技大、市值在 300-500 亿的个股出现持续大幅的调整。二季度、以上情况有所依 贫 但是整体市场仍然表现出小强大弱的格局。

敛。但是整体市场仍然表现出小强大调的格局。 上半年的宏观经济整体不好,主要是地产销售不理想,新开工大幅下滑,导致地产商拿地积极性也不高。所以跟地产相关 的产业整整依数据从上半年来看都偏弱,例如水泥、钢铁等行业。但是在5月份前后,政府的恋度有所转变。以稳婚长为基调 的政策导向开始发力,随后货币稍有放松,所以资本市场在二季度末情绪有所针转,市场风格有转向的迹象。报告期内本基金

4-12 报告期内基金的业绩表现
报告期末。本基金份额净值为 5.027 元,报告期内本基金份额净值增长率为 -14.13%,业绩比较基准收益率为 -1.67%。
4-15 管理人对安观经济。证券市场及行业走势的简要展望
展生 2014 年下半年。本基金从为变观经济的压力不会社上半年低,因为去年下半年的基数较高,所以政府要完成今年的
经治目标、下半年的政策导动或是相对积极的,货币环境大体是变松的,所以市场的整体环境会好于上半年、下半年值得重
点注注的事情是冷港通,新能源年的销量、中央经济会议对明年的定调等。这些事件可能都会对短中期的市场形成影响,对应
的也是不同域块的投资机会。所以本基金相对着时下半年的投资机会。
4-6 管理人对指告期内基金估值的坚等事项的说明
本基金管理人的基金估值和会计核集由基金结算部负责,根据相关的注单注模规定。基金合同的约定,制定了内部控制
措施。对基金值值和会计核集由基金结算部负责,根据相关的注单注模规定。基金合同的约定,制定了内部控制
措施。对基金值值和会计核集由基金结算部负责,根据相关的注单注模规定。基金合同的约定,制定了内部控制
措施。对基金值值和会计核集的各个环节和整个强度进行风险控制。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、为确保基金资价值的公平。合理、金规、有效推荐收资人的构造。基金结算部人及过了天冶基金管理有限公司估值委员
尽以下简称。作值委员会了,则或了有关证券限制。任金是会会成员任金公司投资决赛委员会成员,负责基金的的管理局
以及金融工程小组集步的信值模型和估值转来是行论证申核、并签署被参考的。基金全等多与估值,与金融 层。迅纳博物和运品、速通L程门组等。仍有机大规则与共有干品的现实参查引业为业企业。公司自由案贝亚对了及政百建和 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价价值以进行估值效理,将估值结果提交人司估值委员会。 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,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。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

益的突。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
报告期本基金利润分配情况的说明
报告期本本基金可供分配利润为负数,根据相关注规和基金合同的约定,不进行利润分配。
\$5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
2014年上半年度,基金托管人在天冶格人成长股票型证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守了《证券投资法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议、尽职尽贵地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益为 5.2 托普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 2014年上半年度、天治基金管理有限公司在天治核心成长股票型证券投资基金(LOF)投资运作、基金资产净值的计算、

~~~ 十上十十次。六仁命率百埋月限公司任大冶核心成长股票党证券投资基金(LOF)投资按例额申购赎回价格的计算。基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金特有人利益的行为本报告期内本基金未进行收益分配。 

的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相

§6半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:天治核心成长股票型证券投资基金(LOF)

|          |     |                       | 单位:人民币:                 |
|----------|-----|-----------------------|-------------------------|
| 资产       | 附注号 | 本期末<br>2014年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2013年 12 月 31 日 |
| 资产:      |     |                       |                         |
| 银行存款     |     | 774,638.28            | 56,082,938.59           |
| 结算备付金    |     | 308,709,270.73        | 365,374,301.92          |
| 存出保证金    |     | 974,714.16            | 990,702.99              |
| 交易性金融资产  |     | 1,593,737,908.45      | 1,889,735,073.73        |
| 其中:股票投资  |     | 1,593,737,908.45      | 1,889,735,073.73        |
| 基金投资     |     | -                     | -                       |
| 债券投资     |     | -                     | -                       |
| 资产支持证券投资 |     | -                     | -                       |
| 贵金属投资    |     | -                     | -                       |
| 衍生金融资产   |     | -                     | -                       |
| 买人返售金融资产 |     | -                     | -                       |
| 应收证券清算款  |     | 13,978,849.83         | 6,932,725.86            |
| 应收利息     |     | 131,795.73            | 175,561.89              |

# 天治核心成长股票型证券投资基金(LOF)

### 2014年6月30日

| 应收股利       |     | -                     | -                       |
|------------|-----|-----------------------|-------------------------|
| 应收申购款      |     | 7,692.89              | 42,130.82               |
| 递延所得税资产    |     | -                     | -                       |
| 其他资产       |     | -                     | -                       |
| 资产总计       |     | 1,918,314,870.07      | 2,319,333,435.80        |
| 负债和所有者权益   | 附注号 | 本期末<br>2014年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2013年 12 月 31 日 |
| 负债:        |     |                       |                         |
| 短期借款       |     | -                     | -                       |
| 交易性金融负债    |     | -                     | -                       |
| 衍生金融负债     |     | -                     | -                       |
| 卖出回购金融资产款  |     | -                     | -                       |
| 应付证券清算款    |     | 31,366,675.97         | -                       |
| 应付赎回款      |     | 2,536,306.84          | 2,467,492.48            |
| 应付管理人报酬    |     | 1,819,623.02          | 2,332,399.14            |
| 应付托管费      |     | 379,088.13            | 485,916.48              |
| 应付销售服务费    |     | -                     | -                       |
| 应付交易费用     |     | 2,594,614.27          | 2,805,534.08            |
| 应交税费       |     | 305,587.20            | 305,587.20              |
| 应付利息       |     | -                     | -                       |
| 应付利润       |     | -                     | -                       |
| 递延所得税负债    |     | -                     | -                       |
| 其他负债       |     | 315,728.47            | 618,402.27              |
| 负债合计       |     | 39,317,623.90         | 9,015,331.65            |
| 所有者权益:     |     |                       |                         |
| 实收基金       |     | 1,915,489,300.46      | 2,022,749,146.19        |
| 未分配利润      |     | -36,492,054.29        | 287,568,957.96          |
| 所有者权益合计    |     | 1,878,997,246.17      | 2,310,318,104.15        |
| 负债和所有者权益总计 |     | 1,918,314,870.07      | 2,319,333,435.80        |
|            |     |                       |                         |

注:报告截止日 2014 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.5027 元,基金份额总额 3,737,536 ,481.19 份 6.2 利润表 会计主体:天治核心成长股票型证券投资基金 (LOF)

| 项目                        | 附注号 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2013年 1 月 1 日至 2013 年 6<br>月 30 日 |
|---------------------------|-----|--------------------------------|----------------------------------------------|
| 一、收入                      |     | -293,850,590.19                | 176,788,140.72                               |
| 1.利息收入                    |     | 3,077,203.21                   | 3,002,316.01                                 |
| 其中:存款利息收入                 |     | 3,075,853.07                   | 2,826,289.41                                 |
| 债券利息收入                    |     | 1,350.14                       | -                                            |
| 资产支持证券利息收入                |     | -                              | -                                            |
| 买人返售金融资产收人                |     | -                              | 176,026.60                                   |
| 其他利息收入                    |     | -                              | -                                            |
| 2.投资收益 假失以 ""填列)          |     | -75,543,883.00                 | 178,979,123.26                               |
| 其中:股票投资收益                 |     | -86,296,506.18                 | 169,788,762.78                               |
| 基金投资收益                    |     | -                              | -                                            |
| 债券投资收益                    |     | 334,746.16                     | -                                            |
| 资产支持证券投资收益                |     | -                              | -                                            |
| 贵金属投资收益                   |     | -                              | -                                            |
| 衍生工具收益                    |     | -                              | -                                            |
| 股利收益                      |     | 10,417,877.02                  | 9,190,360.48                                 |
| 3.公允价值变动收益 假失以 ""号填<br>列) |     | -221,392,386.35                | -5,230,457.53                                |
| 4. 汇兑收益(损失以""号填列)         |     | -                              | -                                            |
| 5.其他收入 俶失以 ""号填列)         |     | 8,475.95                       | 37,158.98                                    |
| 减:二、费用                    |     | 25,347,706.12                  | 27,767,763.47                                |
| 1.管理人报酬                   |     | 12,031,217.35                  | 13,941,507.95                                |
| 2.托管费                     |     | 2,506,503.62                   | 2,904,480.88                                 |
| 3.销售服务费                   |     | -                              | -                                            |
| 4.交易费用                    |     | 10,492,457.80                  | 10,664,536.29                                |
| 5.利息支出                    |     | -                              | -                                            |
| 其中:卖出回购金融资产支出             |     | -                              | -                                            |
| 6.其他费用                    |     | 317,527.35                     | 257,238.35                                   |
| 三、利润总额(亏损总额以""号填列)        |     | -319,198,296.31                | 149,020,377.25                               |
| 减:所得税费用                   |     | -                              | -                                            |
| 四、净利润(争亏损以""号填列)          |     | -319,198,296.31                | 149,020,377.25                               |

本报告期:2014年1月1日至 2014年6月30日

|                                               |                                           |                 | THE . 7 CP (11)  |  |  |
|-----------------------------------------------|-------------------------------------------|-----------------|------------------|--|--|
| 项目                                            | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日                |                 |                  |  |  |
|                                               | 实收基金                                      | 未分配利润           | 所有者权益合计          |  |  |
| 一、期初所有者权益 (基金净<br>值)                          | 2,022,749,146.19                          | 287,568,957.96  | 2,310,318,104.15 |  |  |
| 二、本期经营活动产生的基金<br>净值变动数 (本期净利润)                | -                                         | -319,198,296.31 | -319,198,296.31  |  |  |
| 三、本期基金份额交易产生的<br>基金净值变动数<br>(净值减少以""号填列)      | -107,259,845.73                           | -4,862,715.94   | -112,122,561.67  |  |  |
| 其中:1.基金申购款                                    | 6,400,194.68                              | 15,074.00       | 6,415,268.68     |  |  |
| 2.基金赎回款                                       | -113,660,040.41                           | -4,877,789.94   | -118,537,830.35  |  |  |
| 四、本期向基金份额持有人分<br>配利润产生的基金净值变动<br>(净值减少以""号填列) | -                                         | -               |                  |  |  |
| 五、期末所有者权益 (基金净值)                              | 1,915,489,300.46                          | -36,492,054.29  | 1,878,997,246.17 |  |  |
| 项目                                            | 上年度可比期间<br>2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |                 |                  |  |  |
|                                               | 实收基金                                      | 未分配利润           | 所有者权益合计          |  |  |
| 一、期初所有者权益 (基金净<br>值)                          | 2,316,704,269.13                          | -42,866,553.90  | 2,273,837,715.23 |  |  |
| 二、本期经营活动产生的基金<br>净值变动数 (本期净利润)                | -                                         | 149,020,377.25  | 149,020,377.25   |  |  |
| 三、本期基金份额交易产生的<br>基金净值变动数<br>(净值减少以""号填列)      | -125,783,646.40                           | -5,673,237.24   | -131,456,883.64  |  |  |
| 其中:1.基金申购款                                    | 6,877,902.74                              | 279,233.51      | 7,157,136.25     |  |  |
| 2.基金赎回款                                       | -132,661,549.14                           | -5,952,470.75   | -138,614,019.89  |  |  |
| 四、本期向基金份额持有人分<br>配利润产生的基金净值变动<br>(净值减少以""号填列) | -                                         | -               | -                |  |  |
| 五、期末所有者权益 (基金净                                | 2.190.920.622.73                          | 100,480,586,11  | 2.291.401.208.84 |  |  |

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

指南、解释以及其他相关规定(以下各称"仓业会计相制") 编制,同时、对于在具体会计传播的,从8. 项积体会订在则,从6. 项积的的应用 指南、解释以及其他相关规定(以下各称"仓业会计相制") 编制,同时、对于在具体会计核海市信息披露方面。他参考了中国 证券投资基金址协会修订的《证券投资基金会计核海》会指引》,中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金结值业 务的指导意见》、《关于证券投资基金指行《企业会计准则》(结值业务及份额净值计价有关率项的通知》、《证券投资基金信息披露等型办法》、《证券投资基金信息技术等记录》、《证券投资基金信息技术经济》、《证券投资基金信息技术经济》、《证券投资基金信息技术经济。3 号《年度报告和半年度报告》、3. 影生他出现证此《金经验的技术和标》。

至国务院批准,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)交易印花税税率,由原先的

改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让, 暂免征收印花税

3. 个人所得稅 根据财政部、国家稅务总局财稅字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关稅收问题的通知》的规定、对基金取得

的股票的股息、红利收人、债券的利息收人、储蓄存款利息收人,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收人时代扣代缴20%的个人所得税;

根地附放部。国家税务总局财格学(2008)1.25 亏义(粉放部。国家税务总局大于储蓄存款利息的特异余个人所得税政策的通知)的规定。自 2008年10 月9 日起 对诸营存款利息间等存在股个人所得税。 根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税(2012)85 号文(关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知)的规定。自 2013年1月 1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股股汇利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,智诚按 25%计入应纳税所得额;

天治交通

债券交易

债券回购交易

6.4.8.1.2 权证交易

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

期末持有的基金份額

300323

7.1 期末基金资产组合情况

6 银行存款和结算备付金合

A 农、林、牧、渔业 B 采矿业

G 交通运输、仓储和邮政

002241

002236

002008

600535

002594

300315

600406

600633

002146

股票代码

000002

600089

600048

002649

000826

600835

002065

序号

金通灵

2.4。 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

大族激光

荣盛发展 万 科 A

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明约

股票名称

阳光电源

博彦科技

7 300091

I 信息传输、软件和信息技术服务业

居民服务、修理和其他服务

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

注:本基金管理人运用固有资金投资本基金的费率标准与其他相同条件投资者适用 6.4.8.42 报告期求基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况 本基金除基金管理人之外的其他关联方子来依是期末及上年度末均未投资本基金。 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

2014年1月1日至2014年6月30日

18.68

64.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他重要事项。 截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。 \$7 投资组合报告

项目

13,941,507.9

2,685,795.62

单位:人民币元

2013年1月1日至2013年6月30日

2013年1月1日至2013年6月30日

2013年1月1日至2013年6月30日

期末 成本总额

17,957,030.5

金额

1.593,737,908.4

309,483,909.0

1,918,314,870.0

20,252,456.6

130,518,065.56

1,593,737,908.45

2,138,590

2,113,832

2.351.334

1,990,290

2,523,843

1,479,546

2,799,963

82,641,601.10

63,368,451,30

61,380,543.60

61.002.293.40

57,997,912.14

57,361,998.42

55,635,264.81

87,084,385.3

76,753,218,9 73,478,688.42

68,526,049.0

65,049,018.22

61,248,239.08

60,041,269.0

55,441,842,35

55,434,670.84

51,129,831.80

49,503,665.44

84,822,031.9

79,762,148.14 75.701.727.6

70,417,474.54

69,264,838.60

68,854,163.03

68,550,796.68 64,453,682.84

64,017,582.7

61,596,075.00

60,157,519.55

数量(股)

867,823

11.21

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 6.4.9.3 1银行间市场债券正回购 截至本报告期末 2014年 6.月 30 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 截至本报告期末 2014年 6.月 30 日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。 6.4.10 有助于理解积分析会计报表需要应明的其他事项

备注

期末估值总额

16,210,933.6

与基金总资产的比例 %)

"净值比例 %)

84.82

基金资产净值比例 %)

## 2014 半年度 报告摘要

| 应收股利            |     | -                     | -                       | 6.4.8.2.1 基金管理费                                                        |
|-----------------|-----|-----------------------|-------------------------|------------------------------------------------------------------------|
| 应收申购款           |     | 7,692.89              | 42,130.82               |                                                                        |
| 递延所得税资产         |     | -                     | -                       | 项目                                                                     |
| 其他资产            |     | -                     | -                       | - 当期发生的基金应支付的管理<br>## 12,031,217.35                                    |
| 资产总计            |     | 1,918,314,870.07      | 2,319,333,435.80        | 其中:支付销售机构的客户维护                                                         |
| 负债和所有者权益        | 附注号 | 本期末<br>2014年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2013年 12 月 31 日 | 费 2,306,905.35 费 2,306,905.35 产; 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1,20%的年费率计提。计算方法如下; |
| 负债:             |     |                       |                         | H=E×1.20%/ 当年天数                                                        |
| 短期借款            |     | -                     |                         | H 为每日应支付的基金管理费<br>E 为前一日的基金资产净值                                        |
| 交易性金融负债         |     | -                     |                         | 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费                           |
| 衍生金融负债          |     | -                     | 1                       | 人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支                         |
| 卖出回购金融资产款       |     | -                     |                         | 6.4.8.2.2 基金托管费                                                        |
| 应付证券清算款         |     | 31,366,675.97         |                         | 本期上年度可比                                                                |
| 应付赎回款           |     | 2,536,306.84          | 2,467,492.48            | 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013                                    |
| 应付管理人报酬         |     | 1,819,623.02          | 2,332,399.14            | 当期发生的基金应支付的托管 2,506,503.62                                             |
| 应付托管费           |     | 379,088.13            | 485,916.48              |                                                                        |
| 应付销售服务费         |     | -                     | -                       | H=E×0.25%/ 当年天数                                                        |
| 应付交易费用          |     | 2,594,614.27          | 2,805,534.08            | H 为每日应支付的基金托管费<br>E 为前一日的基金管产净值                                        |
| 应交税费            |     | 305,587.20            | 305,587.20              |                                                                        |
| 应付利息            |     | -                     | -                       | . 人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。                       |
| 应付利润            |     | -                     | -                       | 6.4.8.2.3 销售服务费<br>本基金不计提销售服务费。                                        |
| 递延所得税负债         |     | -                     | -                       | 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易                                        |
| 其他负债            |     | 315,728.47            | 618,402.27              | 本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。<br>6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况。     |
| 负债合计            |     | 39,317,623.90         | 9,015,331.65            |                                                                        |
| 所有者权益:          |     |                       |                         |                                                                        |
| 实收基金            |     | 1,915,489,300.46      | 2,022,749,146.19        | 本期 上年度可比   上年度可比   上年度可比   2014年1月1日至2014年6月30日   2013年1月1日至201        |
| 未分配利润           |     | -36,492,054.29        | 287,568,957.96          |                                                                        |
| <b>庇右孝切於</b> 人計 |     | 1 070 007 247 17      | 2 210 210 104 15        |                                                                        |

| 本版日初:2014 〒1711日 王 :                          | 2014 17 0 71 30 11                        |                 | 单位:人民币元          |  |  |
|-----------------------------------------------|-------------------------------------------|-----------------|------------------|--|--|
| 项目                                            | 本期<br>2014年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日      |                 |                  |  |  |
|                                               | 实收基金                                      | 未分配利润           | 所有者权益合计          |  |  |
| 一、期初所有者权益(基金净<br>值)                           | 2,022,749,146.19                          | 287,568,957.96  | 2,310,318,104.15 |  |  |
| 二、本期经营活动产生的基金<br>净值变动数(本期净利润)                 | -                                         | -319,198,296.31 | -319,198,296.31  |  |  |
| 三、本期基金份额交易产生的<br>基金净值变动数<br>(净值减少以 ""号填列)     | -107,259,845.73                           | -4,862,715.94   | -112,122,561.67  |  |  |
| 其中:1.基金申购款                                    | 6,400,194.68                              | 15,074.00       | 6,415,268.68     |  |  |
| 2.基金赎回款                                       | -113,660,040.41                           | -4,877,789.94   | -118,537,830.35  |  |  |
| 四、本期向基金份额持有人分<br>配利润产生的基金净值变动<br>(净值减少以""号填列) | -                                         | -               | -                |  |  |
| 五、期末所有者权益(基金净<br>值)                           | 1,915,489,300.46                          | -36,492,054.29  | 1,878,997,246.17 |  |  |
| 项目                                            | 上年度可比期间<br>2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |                 |                  |  |  |
|                                               | 实收基金                                      | 未分配利润           | 所有者权益合计          |  |  |
| 一、期初所有者权益 (基金净<br>值)                          | 2,316,704,269.13                          | -42,866,553.90  | 2,273,837,715.23 |  |  |
| 二、本期经营活动产生的基金<br>净值变动数(本期净利润)                 | -                                         | 149,020,377.25  | 149,020,377.25   |  |  |
| 三、本期基金份额交易产生的<br>基金净值变动数<br>(净值减少以 ""号填列)     | -125,783,646.40                           | -5,673,237.24   | -131,456,883.64  |  |  |
| 其中:1.基金申购款                                    | 6,877,902.74                              | 279,233.51      | 7,157,136.25     |  |  |
| 2.基金赎回款                                       | -132,661,549.14                           | -5,952,470.75   | -138,614,019.89  |  |  |
| 四、本期向基金份额持有人分<br>配利润产生的基金净值变动<br>(幹值减少以""号填列) | -                                         | -               | -                |  |  |
|                                               |                                           |                 |                  |  |  |

| 直)                                            | 1,913,489,300.40                          | -30,492,034.29 | 1,070,997,240.11 |  |  |
|-----------------------------------------------|-------------------------------------------|----------------|------------------|--|--|
| 项目                                            | 上年度可比期间<br>2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |                |                  |  |  |
|                                               | 实收基金                                      | 未分配利润          | 所有者权益合计          |  |  |
| 一、期初所有者权益 (基金净<br>直)                          | 2,316,704,269.13                          | -42,866,553.90 | 2,273,837,715.23 |  |  |
| 二、本期经营活动产生的基金<br>争值变动数 (本期净利润)                | -                                         | 149,020,377.25 | 149,020,377.25   |  |  |
| 三、本期基金份额交易产生的<br>基金净值变动数<br>(净值减少以 ""号填列)     | -125,783,646.40                           | -5,673,237.24  | -131,456,883.64  |  |  |
| 其中:1.基金申购款                                    | 6,877,902.74                              | 279,233.51     | 7,157,136.25     |  |  |
| 2.基金赎回款                                       | -132,661,549.14                           | -5,952,470.75  | -138,614,019.89  |  |  |
| 四、本期向基金份额持有人分<br>紀利润产生的基金净值变动<br>(净值减少以""号填列) | -                                         | -              | -                |  |  |
| 五、期末所有者权益 (基金净<br>亩)                          | 2,190,920,622.73                          | 100,480,586.11 | 2,291,401,208.84 |  |  |

64.1 基金基本情况 天治核心球长股票型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金"),系经中国证券监管管理委员会(以下简称"中国证监 会")证监基金字2005[134号文《关于同意天治核心成长股票型证券投资基金募集的批复)的核准,由天治基金管理有限公 司作为管理人同社会公开发行募集,基金合同于2006年1月20日正天生效,首次设立募集规模为3133,493,538.86 份基金份 號。本基金分投列型上市开放工,存载期限不定。本基金的基金管理人为天治基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券会 记结算有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。 本金的投资范围为具有良许流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的多类股票、债券以及中国证监会允许基 金投资的其他金融工具、本基金以股票品种产业理投资标的,以"核心一卫星"策略作为股票投资的总体策略。本基金的业绩 比较基准为、富时中国A全指×75%丰富时中国国值指数×25%。

2007年10月15日(拆分日),本基金管理人天治基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分后基金份额面

6.4.2 会计报表的编制基础 本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则一基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用

移動队於例(另4) 5人共同权民的任的通酬以及除了八世分及员参查商总数据 AINL 恢复为 5 5 5 千克取台市十十克取台
> )及其他中国证监会领前的相关规定。
本财务报表以本基金持续完管为基础列报。
64.3 遗憾企业会计量规划支地有关规定的声明
本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年度
的经营成果和价值变动情况。
64.4 重要公计按策和会计估计
本基金本报告期所采用的会计改策、会计估计与 2013 年年度报告一致。
64.5 卷建即下的访問

1条院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴 根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置

在 自显示、正型77号程 根限服效率(国家投募金局局校学)200478号文(关于证券投资基金税收政策的通知)的规定,自 2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票,债券的差价收入,继续免征营业税和 业的作程。 推根制效能、国家税务总局财税字[2005]03 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置 库中法通融股投充通过价价方式向流通股股东支付的股份,现金等收入。暂免证洗通搬股东应缴纳的企业所得税。 根据附数部、国家税务总局财税(2008)1 号文《关于企业所得税等干度进取货的通知)均规定,对证券投资基金从证券市中取得的收入。包括买卖股票,债券的差价收入,股权的股息。红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置

改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入、暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税; 根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的

64.7 关联方关系 64.7.1 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

| 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方 |                                        |  |  |  |  |
|----------------------------|----------------------------------------|--|--|--|--|
| 关联方名称                      | 与本基金的关系                                |  |  |  |  |
| 治基金管理有限公司                  | 基金管理人、基金销售机构                           |  |  |  |  |
| 通银行股份有限公司                  | 基金托管人、基金代销机构                           |  |  |  |  |
| 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易   | VIII VI III VI III VIII VIII VIII VIII |  |  |  |  |
|                            |                                        |  |  |  |  |

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易 6.4.8.1.1 股票交易

| 15                                                                     | 002008 | 大族激光 | 58,918,235.91 | 2.55 |
|------------------------------------------------------------------------|--------|------|---------------|------|
| 16                                                                     | 002353 | 杰瑞股份 | 58,792,521.07 | 2.54 |
| 17                                                                     | 300002 | 神州泰岳 | 58,405,140.75 | 2.53 |
| 18                                                                     | 601169 | 北京银行 | 57,796,135.16 | 2.50 |
| 19                                                                     | 600703 | 三安光电 | 55,690,132.13 | 2.41 |
| 20                                                                     | 601992 | 金隅股份 | 55,506,755.75 | 2.40 |
| 21                                                                     | 601006 | 大秦铁路 | 54,173,808.08 | 2.34 |
| 22                                                                     | 002227 | 奥特迅  | 54,108,870.74 | 2.34 |
| 23                                                                     | 002185 | 华天科技 | 52,774,728.20 | 2.28 |
| 24                                                                     | 002475 | 立讯精密 | 52,755,314.95 | 2.28 |
| 25                                                                     | 300315 | 掌趣科技 | 52,713,154.60 | 2.28 |
| 26                                                                     | 002594 | 比亚迪  | 50,002,734.40 | 2.16 |
| 27                                                                     | 600292 | 中电远达 | 49,351,546.32 | 2.14 |
| 28                                                                     | 600261 | 阳光照明 | 48,752,262.09 | 2.11 |
| 29                                                                     | 002146 | 荣盛发展 | 48,440,963.31 | 2.10 |
| 30                                                                     | 600406 | 国电南瑞 | 48,090,451.54 | 2.08 |
| 31                                                                     | 000581 | 威孚高科 | 47,092,884.50 | 2.04 |
| 注:表中"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。<br>7.43 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额 |        |      |               |      |

3,481,475,214.41 注:表中"买人股票成本"、"卖出股票收 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券。 "卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

本基金本报告期末未持有债券。
7.6 期末按公允价值上基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
木基金水居的期末未持有债券。
7.7 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
本基金水居告期末未持有货产支持证券。
7.8 报告期末投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
本基金水居与期末未持有贵金属。
7.9 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
本基金水居与期末未持有投压。
7.10 报告期末本基金投资的股情期货交易情况说明
本基金水居告期末未持有股值期货。
7.11 报告期末本基金投资的国值期货交易情况说明
本基金水居的期末未持有股值制货。
7.11 报告期末本基金投资的国值制货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货

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内受到公开谴责、处罚的

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。 7.12.3 期末其他各项资产构成 974,714.16 13,978,849.8 131,795.7

15,093,052.61

户均持有的基金 寺有人户数(户 3,694,538,692.09

0.249 8,999,812.9 6,768,819.0 0.189 4,844,000.0 0.139 4,515,680.1 0.129 3,294,716.0

0.00% § 9 开放式基金份额变动

本报告期期初基金份额总额 3,946,821,399.3 本报告期基金总申购份额 221,773,091.40 本报告期基金拆分变动份额 (分额减少) 本报告期期末基金份额总额 3,737,536,481.19 § 10 重大事件揭示

10.2 基金管理人基金性管人的专门基金性管部。即9.主人、中变对 报告期内,基金管理人发生的工事人、非常办。 1.经天冶基金管理有限公司董事会和义通过,聘任赵王妮先生担任公司董事长职务。同时同意高福波先生辞去公司 董事长职务。制任帝法弟先生担任公司总经理职务,同时同意赵王彪先生辞去公司总经理职务。上述事项已按有关规定代 中国证金条件准、备案或报中国基金业协会备案。本基金管理人2014年,19.8 日在指定媒体及公司网络上刊登了 依法 基金管理有限公司高级管理人员变更公告。 2.经元冶基金管理有限公司高级管理人员重要公司董业会和董业会和基金管理人 国基金业协会、中国证金之市局备案。本基金管理人2014年 4 月 25 日在指定媒体及公司网站上刊登了 依治基金管理 有限公司高级管理人负变更公产》。 报告期内,基金社任务人的专门基金社管部门未发生重大人事变动。 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的

报告期内,未改聘会计师事务所。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

券商名称 成交金额 1,643,293,283 1,058,252,675. 874.037.975. 538,701,638, 齐鲁证券 519,009,613.8 479,306,356. 333,870,006.

479,657.8 472,506.8 436,357.9 4.89% 303,954.9 259,822,401. 236,542.0 3.80% 147,729,208.9 134,493.2 华泰联台 湘财证券 国海证券

佣金

941,121.9

795,725.

东北证券

成交金额

券商名称

(4)有较强的研究能力,能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的

(5)建立了广泛的信息网络、能及时准确地提供信息资讯服务。 基金管理人根据以上标准进行考察后、确定证券公司的交易单元作为本基金专用交易单元,并签订交易单元租用协议。

3、报告期内本基金新增方正证券1个交易单元,退租爱建证券1个交易席位. 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

齐鲁证券

成交金額

国金证券 申银万国 湘财证券 国海证券 海通证券

成交金額