## 

基金管理人: 天治基金管理有限公司 送出日期:2015年8月25日

§ 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 益並管理人的選事会、選等除近年放告所並於村个任在原以第、读等任時此為選工、環補、計列具內容的與本生、 確抗和完整性支担。例及连帶的法律所任。本半年度接信之是三分之工以上對立董事签字同意,并由董事长发生。 基金托管人中區之根信行股份有限公司根据本基金合同规定、于 2015年8月24日复核了本报告中的财务指标。净 值表现、利润分值情况、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。 基金管理人承诺以读实信用、勤勉尽责的规则管理和运用基金管产。但不使证基金一定盈利。 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行细阅读本基金的招募说明书及其

本报告中财务资料未经审计。 本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止

平板百朔日 2015 年 1 月 1 日起3	
	§ 2 基金简介
2.1 基金基本情况	
基金简称	天治稳健双盈债券
基金主代码	350006
交易代码	350006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月5日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	258,835,109.34 份
基金合同存续期	不定期
	2.2 基金产品说明
投资目标	在注重资产安全性和流动性的前提下, 追求超越业绩比较基准的和 键收益。
投资策略	本基金根据宏观经济运行状况、货币政策及利率走势的综合判断,; 用自上而下的资产配置与品种选择策略,并充分利用各种金利策略 实现基金的保值增值。此外,本基金可以参与股票一级市场中购和 级市场投资。
业绩比较其准	末其全业结比较其准为由证今债指粉份关密

		2.3 基金管理人和基金托管人						
项	∃	基金管理人	基金托管人					
名称		天治基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司					
姓名		尹维忠	林葛					
信息披露负责人	联系电话	021-60371155	010-66060069					
	电子邮箱	yinwz@chinanature.com.cn	tgxxpl@abchina.com					
客户服务电话		400-098-4800 (免长途通话费用)、 021-34064800	95599					
传真		021-60374934	010-63201816					

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	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	160,053,156.79
本期利润	129,901,878.29
加权平均基金份额本期利润	0.3305
本期基金份额净值增长率	22.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.6736
期末基金资产净值	436,232,489.72
期末基金份额净值	1.6854

注:1、还基金业绩指标不包括持有人认购成交易基金的各项费用、计入费用后实高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组取人、投资收益、其他收入(不含公允价值变对收益)和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对收益。 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款低数(为期末余额、不是

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份	额伸值增长率及	(具与同期业绩):	七轮基准收益率	时比较						
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				
过去一个月	-5.84%	1.25%	0.42%	0.04%	-6.26%	1.21%				
过去三个月	11.59%	1.13%	2.21%	0.09%	9.38%	1.04%				
过去六个月	22.54%	0.97%	3.17%	0.09%	19.37%	0.88%				
过去一年	36.07%	0.72%	8.19%	0.11%	27.88%	0.61%				
过去三年	63.52%	0.57%	13.57%	0.09%	49.95%	0.48%				
自基金合同生效 起至今	74.26%	0.46%	30.35%	0.11%	43.91%	0.35%				
3.2.2	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									

# 基金份额累计净值增长率与同期业额比较基准收益率的历史走势对比例

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2015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 财富增长证券投资基金、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 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务		)期限	从业	说明			
		任职日期	离任日期	年限				
王洋	固定收益部副总监,本基金的 基金经理、天治研究驱动灵活 配置混合型证券投资基金、天 治可转债增强债券型证券投 资基金基金经理。	2015年2 月17日	-	7	数量经济学硕士研究生,具有基金从业资格,历任天治基金管理有限公司交易员、研究员、基金经理助理,现任固定收益部副总监、本基金的基金经理,天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、可转债增强债券型证券投资基金的基金经理。			
秦娟	本基金的基金经理。	2010年 4 月14日	2015年2 月17日	11	经济学硕士研究生,具有基金从业资格,历任广东证券股份有限公司债券分析师、东策级行股份有限公司债券分析师、东策级行股份有限公司债券分析。 长信基金宣单和银货任公司债券研究员,曾任本公司执行总监 固定收益部总监。2010年4月14日至2015年2月17日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。							
	<ul> <li>**T&amp;II.0.65</li> <li>************************************</li></ul>							

在:1、287的12年6月初州高江日前为26月日的庆上日。 2、证券从业的含义遵从行业协会(证券业以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照守信情况的说明 在本报告期内、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。严格遵守 了《证券投资基金法》等有关法律法服,除个别民党出例超标且已调整,未给基金持有人造成损失外,在各重要方面的运 作严格按照《天治稳健双盈债券型证券投资基金基金合同》、《天治稳健双盈债券型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。本报告期内,没有发生损害基金份额

43 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3 管理人对报告期内公平交易情的此时专项应明 4.31 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》、《异 家总监与报告制度》。本基金管理人公平交易体系高监授以,研究分析,投资决策、交易执行,业新评估等投资管理活 动相关的各个环节,并通过评确投资权规划分、建立先一研究报告管理平台、为定、效率之可及及投资组合的投资 对身各选库和交易对手各选库。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 等是是当他公益等。 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 并形交为17.794900时 据告期内,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同日反向交易的情形,未发生所有投资组合参 9交易所公开竞价同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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析 2015年上半年债券市场总体收益水平继续下行,但短端下行明显多于长端,收益率曲线呈现陡峭化下行.原因如下:央 

宽松流动性的预期不断上升,加之杠杆资金推波助澜,使得权益市场在二季度出现惊人暴涨,而随着5月末央行在公开市 场上对部分银行进行的定向正回购的开展,并减少了 MLF 的续做量,宣告了其对短期流动性和短端利率下限的政策边际,也给市场投资者对于流动性过于宽松的非理性预期淡了冷水。因此,在6月这样一个传统流动性收缩的月份,伴随证

近公时则能及少7/115以平时自建。11799年来的1269年2 在这样一个市场扩展和宏观背景下,稳健及至 2015 年上半年的投资运作基本根据这一市场节奏不断调整资产配置, 对权益资产进行减持,并增加了纯债品种的配置。总的来看,基本略准了市场节奏。

报告期末,本基金份额净值为1.6854元,报告期内本基金份额净值增长率为22.54%,业绩比较基准收益率为3.17%, 高于同期业绩比较基准收益率 19.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 4.5 管理人对宏观空济、证券印动及了亚定势的阅读限望 回顾 2015年 上半年录程/订于市场和灾速经济的预测、基本上符合我们的判断,超出我们预期的是,央行货币政策放 松幅度超出预期,所带来的超级宽焓的流动性超出预期,因此,对于市场投资者超级乐观的流动性预期估计不足。展望全 年,我们从为权益市场和债券市场仍然具有结构生的投资机会,就权益市场来看,可转债市场的供需失衡没有得到改善。 仍然具有稀缺性,而股票市场中、经过。月系统、部分质地较好,业绩可期的统规配合进入投资价值区域。而被倾市场方面,国网络济仍然不履、通胀水平仍然丰常低迷。目前极为陡峭的收益率曲线与市场情况并不相符,未来长端与短端利差

有收窄的要求,因此,长债具有显著的投资机会。 因此,我们将根据市场的情况谨慎操作权益资产,同时继续重点关注纯债品种的投资机会。 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

46 管理人对报告期内基金估值程序等事如照识明 本基金管理人的基金估值和会计核算由基金结算部负责、根据相关的法律法规规定、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、合理、有效能冲投资人的利益、本基金管理人设立了天冶基金管理有限公司估值委员会(17 简称"估值要员会(17 简称"的基金管理有限公司转,任债委员会成员但括公司投资决策委员会成员,成员基金结算的管理层、监察储核部总监、金融工程小组等,所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会 对于投资管理部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 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

国安贝云。 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

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。

基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份 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

2.1 TEA(A) 成日前外外本企业以及正存整心,中国19年7年7月,是19年7日,从19年7日,19年

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 本托管人认为、天治基金管理有限公司信息投票事务符合证券投资基金信息按赛管理办法)及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和坡赛的本基金年度报告中的财务指标。净值表现,收益分配情况,财务会计报告、投资组合

# 天治稳健双盈债券型证券投资基金

### 2015 半年度 报告摘要

### 2015年6月30日

报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

+主体:天治稳健双盈债券型证券投资基金

资产	附注号	本期末 2015年 6 月 30 日	上年度末 2014年 12 月 31 日
资产:		2000   072 00 00	
银行存款		58,509,892.74	28,629,029.86
结算备付金		1,853,799.42	4,621,106.19
存出保证金		250,325.63	334,907.60
交易性金融资产		460,544,324.96	823,581,886.3
其中:股票投资		38,455,949.26	122,394,556.0
基金投资		_	
债券投资		422,088,375.70	701,187,330.3
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		_	
应收利息		5,866,176.70	13,973,412.9
应收股利		_	
应收申购款		653,308.19	171,756.6
递延所得税资产		_	
其他资产		_	
资产总计		527,677,827.64	871,312,099.6
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年 6 月 30 日	上年度末 2014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		64,799,591.80	127,499,986.0
应付证券清算款		11,206,516.07	16,516,510.0
应付赎回款		12,478,627.12	5,843,423.2
应付管理人报酬		338,207.18	460,709.5
应付托管费		96,630.63	131,631.2
应付销售服务费		144,945.93	197,446.9
应付交易费用		1,234,053.91	1,207,908.9
应交税费		972,020.00	972,020.0
应付利息		43,708.99	83,146.9
应付利润		-	
递延所得税负债		-	
其他负债		131,036.29	241,860.0
负债合计		91,445,337.92	153,154,642.9
所有者权益:			
实收基金		258,835,109.34	522,163,357.3
未分配利润		177,397,380.38	195,994,099.3
所有者权益合计		436,232,489.72	718,157,456.6
负债和所有者权益总计		527 677 827 64	871.312.099.6

6.2 利润表

会计主体:天治稳健双盈债券型证券投资基金

项目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年 1 月 1 日至 2014年 6 月 30 日
一、收入		137,658,902.17	52,530,077.87
1.利息收入		10,730,207.65	18,216,640.56
其中:存款利息收入		202,404.94	210,181.32
债券利息收入		10,489,832.60	17,887,917.40
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收人		37,970.11	118,541.84
其他利息收入		-	_
2.投资收益 假失以""填列)		157,013,748.33	-43,942,326.74
其中:股票投资收益		63,854,813.42	-4,600,019.15
基金投资收益		-	_
债券投资收益		93,066,716.98	-40,400,642.60
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		92,217.93	1,058,335.01
3.公允价值变动收益 假失以 ""号填 列)		-30,151,278.50	78,129,829.79
4. 汇兑收益(损失以""号填列)		-	-
5.其他收入 假失以""号填列)		66,224.69	125,934.26
減:二、费用		7,757,023.88	13,107,721.21
1.管理人报酬		2,092,087.71	3,114,328.55
2.托管费		597,739.31	889,808.18
3.销售服务费		896,609.01	1,334,712.15
4.交易费用		1,767,196.00	2,688,129.30
5.利息支出		2,246,523.20	4,935,579.20
其中:卖出回购金融资产支出		2,246,523.20	4,935,579.20
6.其他费用		156,868.65	145,163.83
三、利润总额 传损总额以""号填列)		129,901,878.29	39,422,356.66
减:所得税费用		-	-
		+	

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:天治稳健双盈债券型证券投资基金 本报告期:2015年1月1日 至 2015年6月30日

			单位:人民币
项目	2015	本期 年1月1日至2015年6月30日	3
	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 值)	522,163,357.31	195,994,099.35	718,157,456.66
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数(本期净利润)	-	129,901,878.29	129,901,878.29
三、本期基金份额交易产生的 基金净值变动数 (净值减少以""号填列)	-263,328,247.97	-148,498,597.26	-411,826,845.23
其中:1.基金申购款	315,474,330.63	183,092,277.30	498,566,607.93
2.基金赎回款	-578,802,578.60	-331,590,874.56	-910,393,453.16
四、本期向基金份额持有人分 配利润产生的基金净值变动 (净值减少以""号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净 值)	258,835,109.34	177,397,380.38	436,232,489.72
项目	2014	上年度可比期间 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	3
	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 值)	843,523,157.29	153,386,199.85	996,909,357.14
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数(本期净利润)	-	39,422,356.66	39,422,356.66
三、本期基金份额交易产生的 基金净值变动数 (净值减少以""号填列)	-142,518,262.16	-25,574,115.51	-168,092,377.67
其中:1.基金申购款	647,182,860.38	126,596,885.16	773,779,745.54
2.基金赎回款	-789,701,122.54	-152,171,000.67	-941,872,123.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以""号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 堪金净值)	701,004,895.13	167,234,441.00	868,239,336.13

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署: 主管会计工作负责人 会计机构负责人

天治稳健双盈债券型证券投资基金 (以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证 午可[2008]817号文《关于核准天治稳健双盈债券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 i社会公开发行募集,基金合同于 2008 年 11 月 5 日正式生效,首次设立募集规模为 787,576,971.03 份基金份额。本基金为契

为型开放式,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基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份 水区中3。 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票、权证以及法律法规或中国证监会 作基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为中证全债指数收益率。 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、其后颁布的应用指 南、解释记及其他相关规定(以下各称"企业会计准则")编制。同时、对于在"规则"為"规则关系"对任则"表中规则"的。现实体系引 (证则、共正规件的总址对重 寿业协会制定的《证券投资基金会计核聚业多指引》,中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金信值业务的指导意 见》、《关于证券投资基金信息按露内容。在业会计准则》后值业多及份额争值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息按露管理 办法》、《证券投资基金信息按露内容与格式准则》第 3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息按露自理规则》 第 3号《会计报表树注的编制及披露》、《证券投资基金信息按露 XBRL 模板第 3号《年度报告和半年度报告》及其他中国 "证验人必然少据》。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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 2015年 06月 30日的财务状况以及 2015年上半年度

1925年300米平697组文列(1970-64.4 重要公计按策和5公计的 本程告期所采用的会计按策与2014年年度报告相一致。本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号(关于发布、中国证券投资基金业协会估值核算工作小组长于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的通知》的 规定,交易所上市交易或挂牌岭让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的 估值数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.3 会计政策和经验计估计变更以及差错更正的说明 4.4.1。 会计数策变更的说明 本基金本报告期无会计致策变更。 6.4.2 会计估计变更的说明 本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号(关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作 小组关于 2015年1 季度固定收益品种的估值处理标准 > 的通知)的规定,交易所上市交易或挂牌特让的固定收益品种(可转 换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

..印花棁 全国多院批准,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 3%。

经国务院批准,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,股权分置改 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。

等及往中区中市间面积200米,中间加强200米,中间加强200米,1970年,2月20日,日光正改计时代表。 2.营业税、企业所得税 根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78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

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企业所得税; 根据财政部、国家税务总局财税12008/1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场 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,暂不征收企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字(2002)128号文(关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知)的规定、对基金取得的股票的股息、红利收人、债券的利息收入、储蓄存款利息收入。由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代

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 根据财政部。国家股总总局、中国证益会财权[2012]85 亏义 (天于实施上印公司政息31利差别代个人所得税政策有关问题的通知)的规定。自 2013年 1月 日起,证券投资基金从公平发布辖户市场取得的。由公司股票,持股期限股份,行用以入(含1个月)的,其股息红利所得金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,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1年的,管减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1年的,管减按 50%计入应纳税所得额;相拟救敌部 国家税务总局财税字2005[10] 亏义 (关于散投分置试点改革有关税收改策问题的通知)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反付的股份,现金等收入、暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。推规财政部、国家税务总局财税字(2008]132 亏炎《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所属年发个人所得税政策的。

通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7.1 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 4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称 基金管理人、注册登记机构、基金销售

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 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。 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

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 6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 2015年1月1日至2015年6月30日

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70%的年费率计提。计算方法如下

H=E×0.70%/ 当年大致 H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,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,经基金托管人复核后于次月首日 起3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、休息日,支付日期顺延。

本期 2015年1月1日至2015年6月30日 项目 2014年1月1日至2014年6月30日 597,739.31 889,808.18

H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值

单位:人民币元

39,422,356.66

注:(1)本基金销售服务费用于本基金的销售与基金份额持有人服务等。

基金托管费每日计摄,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费则计指令,经基金托管人复核后于次月首日个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

本期 2015年1月1日至2015年6月30日 获得销售服务费 各关联方名称

H 为每日应计提的基金销售服务费 日为每日应订锭的基金新自mx770、 E为前一日基金资产净值 基金销售服务费每日计提 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次

月首日起3个工作日内从基金财产中划出,由注册登记机构代收,注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构 (2)若干比较数据已进行重述,以符合本年度之列报要求。

(4)在1 LU表现的近江1单近20村日中干坡之为00安水。 6.483 与关联方进行银行间周业市场的债券含回购分募 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。

在通常情况下,基金销售服务费核前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下: $H=E \times$ 年基金销售服务费率÷当年天数,本基金的年基金销售服务费率为0.3%

6.48.4 报告即内基金管理人。是用固有资金投资本基金的情况 本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。 6.48.4 报告期末缔基金管理人之外的连接关联方投资本基金的情况 本基金龄基金管理人之外的连接关联方报资本基金的情况 本基金龄基金管理人之外的使关联方开发的表现,是一种更大均未投资本基金。 6.48.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日 期末余额 58,509,892.74 172,408.84 14,557,969.9 169,694.1

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。 6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券

0.1.7.	293710	10 13 113 1	46313	/17 NT () ((ALL) X.)	PAUAZI				金额单位	:人民币
股票代码	股票名称	停牌 日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 段)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
00226	卫士通	2015 年 5 月 8 日	临时 停牌	80.14	-	-	180,000	13,375,033.00	14,425,200.00	-
00236 8	太极股份	2015 年 5 月 14 日	临时 停牌	52.73	1	-	211,351	10,435,736.58	11,144,538.23	

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2015 年 06 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 6,000,000.00 元 于 2015 年 7 月 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和 / 或在新质押式回购下转人质押库 的创情,接近接交易所规定的比例所屬为海地共产品不同于债券回购交易的余额。 64.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 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

7.1 期末基金资产组合情况

占基金总资产的比例 %)	金額	项目	序号
7.2	38,455,949.26	权益投资	1
7.2	38,455,949.26	其中:股票	
79.9	422,088,375.70	固定收益投资	2
79.9	422,088,375.70	其中:债券	
	-	资产支持证券	
	-	贵金属投资	3
	-	金融衍生品投资	4
	-	买人返售金融资产	5
	-	其中:买断式回购的买人返售金融资产	
11.4	60,363,692.16	银行存款和结算备付金合计	6
1.2	6,769,810.52	其他各项资产	7
100.0	527,677,827.64	合计	8

占基金资产净值比例 %)	公允价值	行业类别	代码
	_	农、林、牧、渔业	A
	_	采矿业	В
	-	制造业	С
	-	电力、热力、燃气及水生产和供应业	D
	-	建筑业	E
	-	批发和零售业	F
	-	交通运输、仓储和邮政业	G
	-	住宿和餐饮业	Н
5.8	25,569,738.23	信息传输、软件和信息技术服务业	I
	-	金融业	J
	-	房地产业	K
	-	租赁和商务服务业	L
	-	科学研究和技术服务业	M
	-	水利、环境和公共设施管理业	N
	-	居民服务、修理和其他服务业	0
	_	教育	P
	-	卫生和社会工作	Q
	-	文化、体育和娱乐业	R
2.9	12,886,211.03	综合	S
8.82	38,455,949.26	合计	

7.3 班	/3 州木技公儿川自白垄亚英厂中自几例人小排户的用于石灰米技英明细								
	金额单位:人民								
序号	股票代码	股票名称	数量 般)	公允价值	占基金资产净值比例 %)				
1	002268	卫士通	180,000	14,425,200.00	3.31				
2	600895	张江高科	442,673	12,886,211.03	2.95				
3	002368	太极股份	211,351	11,144,538.23	2.55				
	9.4 担任相由机面机效和人的重上定击								

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

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例 %)	
1	300226	上海钢联	31,166,311.60	4.34	
2	002260	伊立浦	22,050,180.16	3.07	
3	600895	张江高科	22,019,548.84	3.07	
4	600271	航天信息	21,717,359.00	3.02	
5	300085	银之杰	21,047,733.64	2.93	
6	300011	鼎汉技术	17,995,630.32	2.51	
7	300352	北信源	17,795,652.83	2.48	
8	603019	中科曙光	17,266,401.02	2.40	
9	300139	福星晓程	16,385,244.18	2.28	
10	002268	卫士通	15,604,205.17	2.17	
11	002439	启明星辰	15,447,077.48	2.15	
12	002368	太极股份	14,812,863.75	2.06	
13	300369	绿盟科技	14,313,279.70	1.99	

14	002184	海得控制	13,871,184.00	1.93
15	002496	辉丰股份	13,695,291.37	1.91
16	002245	澳洋顺昌	13,478,924.14	1.88
17	002009	天奇股份	12,762,007.80	1.78
18	600031	三一重工	12,224,378.15	1.70
19	600682	南京新百	11,797,372.10	1.64
20	300017	网宿科技	11,607,035.53	1.62

注:表中"买人金额"按买人成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。 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
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 %)
1	300226	上海钢联	31,405,422.75	4.37
2	300085	银之杰	25,860,912.17	3.60
3	002439	启明星辰	24,664,018.00	3.43
4	300011	鼎汉技术	24,074,501.82	3.35
5	300369	绿盟科技	23,547,193.20	3.28
6	300139	福星晓程	23,364,815.68	3.25
7	600000	浦发银行	22,928,900.20	3.19
8	601166	兴业银行	22,055,721.74	3.07
9	600015	华夏银行	21,167,720.28	2.95
10	002260	伊立浦	20,729,177.40	2.89
11	603019	中科曙光	19,702,038.00	2.74
12	600271	航天信息	19,527,821.67	2.72
13	600823	世茂股份	19,250,203.52	2.68
14	300352	北信源	18,265,841.94	2.54
15	002184	海得控制	18,136,719.63	2.53
16	002496	辉丰股份	16,737,640.02	2.33
17	002009	天奇股份	15,129,910.04	2.11
18	300353	东土科技	14,397,505.00	2.00
19	600682	南京新百	14,174,079.89	1.97
		1 1- 1 1-		

"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

7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额 单位:人民币元 490,822,578.43 629,422,489.58 卖出股票收入 (成交)总额

占基金资产净值比例 66) 150,705,000.00 其中:政策性金融信 5 企业短期融资券 10.115.000.00 2.32 6 中期票据 45,260,375.70

7.6 其	用末按公允价值占基	金资产净值比例	大小排序的前五名	债券投资明细		
					金额单位:人民币	ńΰ
字号	债券代码	债券名称	数量 胀)	公允价值	占基金资产净值比例 %)	
1	150211	15国开11	700,000	70,245,000.00	16.10	
2	150210	15国开 10	400,000	40,372,000.00	9.25	
3	1480242	14嘉公路	300,000	31,473,000.00	7.21	
4	1380243	13振湘治理债	300,000	31,446,000.00	7.21	
5	1380187	13渝双桥债	300,000	30 789 000 00	7.06	

422,088,375.70

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。 7.8 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贵金属投资明细

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

7.11 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。 7.12 投资组合报告附注

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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 单位:人民币元

250,325.63 7.12.4 期末持有的外干转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

金额单位:人民币元

流通受限情况说明

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允的

2 002368 太极股份 由于四舍五人的原因,分项之和与合计项可能存在尾差

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 寺有人户数(户

§ 8 基金份额持有人信息

6,364 40,671.76 118,822,211.4 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 60,207.35 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 持有基金份额总量的数量区间 (万份) 公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人 有本开放式基金

§ 9 开放式基金份额变动 787,576,971.03 太报告期期初基金份额总额 315,474,330.6 578,802,578.6 258,835,109.3

§ 10 重大事件揭示

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

报告期内,基金管理人发生如下重大人事变动: 经大方品金管理有限公司董事会市以通过;同意时冰先生养去公司副总经理职务。上述事项已按有关规定报中国基金业协会,中国贮盈会上场的条、本金管理人 2015年1月23日在指定媒体及公司网站上刊签了《大冶基金管理人程》 公司高级管理人员变更公告》。 报告期内、基金任官人的专门基金托管阁门未发生重大人事变动。 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 报告期内,无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项

报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处 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

1年班:八民川	325 (194					
备注	应支付该券商的佣金		股票交易			
	占当期佣金 总量的比例	佣金	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	交易单元数 量	券商名称
-	53.82%	538,626.06	54.33%	608,684,575.50	1	国金证券
-	31.52%	315,426.73	30.93%	346,470,055.64	1	中信建投
-	12.49%	124,994.78	12.61%	141,252,751.15	1	招商证券
-	2.17%	21,702.02	2.13%	23,837,685.72	1	中银国际
-	-	-	-	-	1	华西证券

注:1、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。

2、基金专用交易单元的选择标准和程序: (2)公司财务状况良好;

(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行祭后,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华西证券有限责任公司1个交易单元。

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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券 回购 成交总额的 比例	成交金額	占当期权证 成交总额的比 例
国金证券	73,695,970.88	7.44%	19,943,000.00	1.72%	-	-
中信建投	630,037,463.52	63.57%	985,600,000.00	84.92%	-	-
招商证券	26,096,294.44	2.63%	-	-	-	-
中银国际	261,300,215.57	26.36%	155,100,000.00	13.36%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

自 2015年3月30日起,根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理 标准》,本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种 (估值处理标准另有规定的除外),主要依据由第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的价格数据进行估值。详情请见 2015 年 3 月 31 日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站发布的《天治基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定

天治基金管理有限公司