

天治核心成长混合型基金(LOF)

2015 第四季度 报告

2015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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

81 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。

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, etc.

83 主要财务指标和基金净值表现

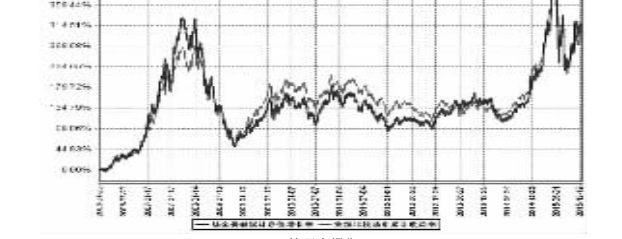
Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)

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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



84 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

注:1、表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。

2、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《天治核心成长混合型基金(LOF)基金合同》、《天治核心成长混合型基金(LOF)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财产,为基金份额持有人谋求利益。

3、报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》和《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定,基金运作合法合规,投资策略符合基金合同约定,基金业绩表现良好。

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.2.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年四季度各项指数均呈大幅上涨的态势,整个四季度HS300上涨16.49%,中小板指上涨23.81%,创业板上涨30.32%。

4.2.2 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未发生交易所公开竞价同日反向交易的情况,未发生所有投资组合参与的与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。

4.3 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《证券投资基金法》和《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定,基金运作合法合规,投资策略符合基金合同约定,基金业绩表现良好。

4.4 报告期内基金的投资组合报告
4.4.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金总资产比例(%)

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)

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金总资产比例(%)

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)

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

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元)

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

Table with 5 columns: 序号, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元)

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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元)

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除广发证券(股票代码:000776)外,其余的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。

广发证券于2015年8月24日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《调查通知书》(证监调查字[2015]502号),因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份涉嫌违法违规,被中国证监会立案调查。

2014年9月,广发证券对杭州恒生网络技术服务有限公司(HOMS系统)(以下简称“HOMS系统”)进行接入,同年12月,广发证券上海分公司对该系统进行升级并升级升级,于2015年5月19日,升级完成。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票投资明细

5.11.3 报告期内本基金投资的前十名债券投资明细

5.11.4 报告期内本基金投资的前十名资产支持证券投资明细

5.11.5 报告期内本基金投资的前十名权证投资明细

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

86 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 基金名称, 单位:份

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21

报告期末基金份额总额 69,803,723.21