

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

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中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。

基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年10月23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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中期财务资料未经审计。
本报告日期自2015年10月1日起至12月31日止。

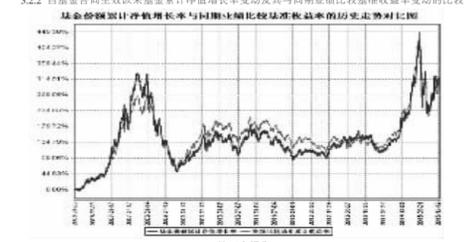
Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金存续期限, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

3.1 主要财务指标

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

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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 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.注:基金合同生效以来基金经理发生变更,请参见《证券投资基金法》和《证券投资基金管理条例》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
在本报告期内,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资产,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,报告期内,基金运作合法合规,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 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》(《异常交易监控与报告制度》),本基金管理人公平交易体系全面覆盖授权、研究分析、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,并通过明确授权权限划分、建立统一研究报告管理平台、分层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程序,定期对不同投资组合收益率差异、交易价差、成交量等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 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形,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。
4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内本基金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%,回顾四季度整体走势,在短期利空见底、政策呵护下,A股市场呈现百花齐放、大幅反弹态势,根据基金设计对资产配置的要求,本基金四季度继续执行了大小盘相对均衡的配置策略,通过积极跟踪政策导向,11月初重仓创业板及12月初重仓地产板块并持续增持,阶段性较好的把握了大盘反弹的投资机会,主题方面,12月重点配置传媒及云计算相关主题,为投资者保持了良好的投资收益。
2016年1季度,在搭棚机制适应期内,叠加大股东减持预期,市场大概率仍然维持区间震荡行情,依然没有实质性突破,我们看好国企改革,中国制造业2025,油页岩等主题的投资机会。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金份额净值为0.9107元,报告期内本基金份额净值增长率为20.35%,业绩比较基准收益率为17.63%,高于同期业绩比较基准收益率为2.72%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 基金资产组合, 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 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 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(%)

5.4 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债券投资明细

Table with 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(%)

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资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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五名贵金属投资明细

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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权证投资明细

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.9 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.10 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.12 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.13 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.14 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.15 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.16 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.17 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.18 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.19 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.20 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.21 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.22 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.23 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.24 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.25 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.26 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.27 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.28 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.29 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.30 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.31 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.32 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.33 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.34 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.35 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.36 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.37 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.38 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.39 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.40 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.41 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.42 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.43 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.44 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.45 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.46 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.47 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.48 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.49 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.50 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.51 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.52 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.53 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.54 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.55 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.56 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.57 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.58 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.59 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.60 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.61 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.62 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.63 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.64 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.65 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.66 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.67 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.68 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.69 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.70 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.71 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.72 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.73 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.74 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.75 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.76 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.77 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.78 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.79 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.80 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.81 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.82 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.83 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.84 报告期末持有的流通受限证券投资

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.85 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 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.86 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 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.87 报告期末持有的流通受限