

天治可转债增强债券型证券投资基金

2013第四季度报告

2013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
报告送达日期:二〇一四年一月十一日

§ 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。
基金托管人承诺以诚实信用、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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	天治可转债增强债券
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月6日
报告期末基金份额总额	353,896,308.06份
投资目标	本基金重点投资于可转换债券(含可分离交易可转换债券)，努力在控制投资组合风险下实现基金资产的稳定增值。

本基金80%以上的基金资产投资于债券类资产，其中严控信用风险的前提下，通过投资于可转换债券、可分离交易可转换债券、股票质押回购、货币市场工具、权证、国债期货、商品期货、期权、权证、资产支持证券、债券回购、逆回购、衍生品等金融工具，力争在控制风险的前提下，实现基金资产的稳定增值。

基金的投资策略：本基金将根据宏观经济形势、债券市场的收益率变化率、不同类型的债券的相对投资价值、确定不同类型的债券在组合中的合理配置比例。

业绩比较基准：中债综合指数收益率。

风险收益特征：本基金为债券型基金，属于债券型基金中较低风险品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于货币市场基金及现金管理类基金。

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。

下属分级基金的基金简称

天治可转债增强债券A 级 天治可转债增强债券C 级

下属分级基金的代码

000000 000001

报告期末A类基金份额的总额

290,982,409.71份 63,003,699.25份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

天治可转债增强债券A 级 天治可转债增强债券C 级

1.本期已实现收益 -8,962,239.45 -2,076,451.33

2.本期利润 -22,408,946.74 -5,271,962.81

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0654 -0.0674

4.期末基金资产净值 270,481,322.21 58,439,454.30

5.期末基金份额净值 0.930 0.928

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据。2.本期实现收益指本期利息收入、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, 本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.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

1.天治可转债增强债券A级:

阶段 净值增长① 0.51% 2.68% 收益率标准差③ 0.10% -4.32% 0.41%

过去一个月 -7.00% 0.49% -2.68% 0.10% -4.33% 0.39%

2.天治可转债增强债券C级:

阶段 净值增长① 0.49% 2.68% 收益率标准差③ 0.10% -4.32% 0.41%

过去一个月 -7.01% 0.49% -2.68% 0.10% -4.33% 0.39%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

天治可转债增强债券型证券投资基金

累计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

(2013年6月4日至2013年12月31日)

1.天治可转债增强债券A级:

2.天治可转债增强债券C级:

注:1.按照基金合同规定, 本基金投资于固定收益类(包括国债、地方政府债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债、货币市场基金、次级债、中小企业私募债、债券回购等)的比例不低于基金资产的80%;其中对可分离交易可转债、货币市场基金的投资比例不超过基金资产的20%。现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金在2013年6月4日基金合同生效日起六个月内, 达到了本基金合同第12章“部分资金”的条款, 规定的最低投资比例。

2.自基金合同生效日起至报告期末, 本基金未作定期报告。

3.2.3 本报告期内基金的可供分配利润

3.2.4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
秦娟	总经济师、大客户服务总监、基金经理、基金经理助理、风险管理部总监	2013-6-4	-	9

注:本基金在任期内, 由秦娟担任基金经理。

2.证券投资基金从业人员遵纪守法情况的说明。

4.2 报告期内本基金无涉及诉讼的情况说明。

4.3 公平交易制度执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 不同投资组合之间公平交易情况的说明

4.3.3 公平交易制度执行情况的说明

4.3.4 公平交易制度执行情况的说明

4.3.5 公平交易制度执行情况的说明

4.3.6 公平交易制度执行情况的说明

4.3.7 公平交易制度执行情况的说明

4.3.8 公平交易制度执行情况的说明

4.3.9 公平交易制度执行情况的说明

4.3.10 公平交易制度执行情况的说明

4.3.11 公平交易制度执行情况的说明

4.3.12 公平交易制度执行情况的说明

4.3.13 公平交易制度执行情况的说明

4.3.14 公平交易制度执行情况的说明

4.3.15 公平交易制度执行情况的说明

4.3.16 公平交易制度执行情况的说明

4.3.17 公平交易制度执行情况的说明

4.3.18 公平交易制度执行情况的说明

4.3.19 公平交易制度执行情况的说明

4.3.20 公平交易制度执行情况的说明

4.3.21 公平交易制度执行情况的说明

4.3.22 公平交易制度执行情况的说明

4.3.23 公平交易制度执行情况的说明

4.3.24 公平交易制度执行情况的说明

4.3.25 公平交易制度执行情况的说明

4.3.26 公平交易制度执行情况的说明

4.3.27 公平交易制度执行情况的说明

4.3.28 公平交易制度执行情况的说明

4.3.29 公平交易制度执行情况的说明

4.3.30 公平交易制度执行情况的说明

4.3.31 公平交易制度执行情况的说明

4.3.32 公平交易制度执行情况的说明

4.3.33 公平交易制度执行情况的说明

4.3.34 公平交易制度执行情况的说明

4.3.35 公平交易制度执行情况的说明

4.3.36 公平交易制度执行情况的说明

4.3.37 公平交易制度执行情况的说明

4.3.38 公平交易制度执行情况的说明

4.3.39 公平交易制度执行情况的说明

4.3.40 公平交易制度执行情况的说明

4.3.41 公平交易制度执行情况的说明

4.3.42 公平交易制度执行情况的说明

4.3.43 公平交易制度执行情况的说明

4.3.44 公平交易制度执行情况的说明

4.3.45 公平交易制度执行情况的说明

4.3.46 公平交易制度执行情况的说明

4.3.47 公平交易制度执行情况的说明

4.3.48 公平交易制度执行情况的说明

4.3.49 公平交易制度执行情况的说明

4.3.50 公平交易制度执行情况的说明

4.3.51 公平交易制度执行情况的说明

4.3.52 公平交易制度执行情况的说明

4.3.53 公平交易制度执行情况的说明

4.3.54 公平交易制度执行情况的说明

4.3.55 公平交易制度执行情况的说明

4.3.56 公平交易制度执行情况的说明

4.3.57 公平交易制度执行情况的说明

4.3.58 公平交易制度执行情况的说明

4.3.59 公平交易制度执行情况的说明

4.3.60 公平交易制度执行情况的说明

4.3.61 公平交易制度执行情况的说明

4.3.62 公平交易制度执行情况的说明

4.3.63 公平交易制度执行情况的说明

4.3.64 公平交易制度执行情况的说明

4.3.65 公平交易制度执行情况的说明

4.3.66 公平交易制度执行情况的说明

4.3.67 公平交易制度执行情况的说明

4.3.68 公平交易制度执行情况的说明

4.3.69 公平交易制度执行情况的说明

4.3.70 公平交易制度执行情况的说明

4.3.71 公平交易制度执行情况的说明

4.3.72 公平交易制度执行情况的说明

4.3.73 公平交易制度执行情况的说明

4.3.74 公平交易制度执行情况的说明

4.3.75 公平交易制度执行情况的说明

4.3.76 公平交易制度执行情况的说明

4.3.77 公平交易制度执行情况的说明

4.3.78 公平交易制度执行情况的说明

4.3.79 公平交易制度执行情况的说明

4.3.80 公平交易制度执行情况的说明