

2013年3月29日 星期五

基金管理人:天治基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送达日期:二〇一三年三月二十九日

§ 1 重要提示及目录

基金管理人的董事会、董事会对本基金报告期内不存在虚假记载、误导性陈述的重大遗漏，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金报告书已经三分之二以上独立董事签字同意，并报中国证监会备案。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本合同规定，于2013年3月28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，保证复核报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人和基金托管人承诺对本基金定期报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并不表示其未来一定期间的投资风险。投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 天治稳定收益债券型证券投资基金
基金代码 350009
交易代码 350009
基金运作方式 约定开放式
基金合同生效日 2011年12月28日
基金管理人 天治基金管理有限公司
基金托管人 中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额 170,557,890.59份

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，追求长期的稳定收益。
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，运用自上而下的资产配置与自下而上的品种选择策略，通过目标久期管理、资产配置、久期调整等操作方法，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略 本基金在充分运用各种投资策略提升组合持有的预期收益率、实现基金的保值增值同时，本基金将在保持基金资产流动性和安全性的前提下，积极参与新股申购，有效提高基金资产的流动性。
业绩比较基准 中债综合(全价)指数。
风险收益特征 本基金属于主动管理的债券型基金，为证券投资基金中的较低风险收益品种，预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	天治基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
姓名	张丽虹	宋义明
联系电话	021-60371155	010-6556899
电子邮箱	zhanghi@chinatime.com.cn	zhuyiming@icibank.com

客户服务电话 400-098-4800(免长途话费) 95558

传真 021-60374934 010-65550832

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址: www.chinatime.com.cn

基金年度报告备置地点: 基金管理人及基金托管人的办公场所

3.3 主要数据和财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年12月28日至2011年12月31日	2010年
本期实现收益	17,512,886.91	37,064.08	-
本期利润	16,663,128.43	217,180.71	-
加权平均基金份额本期利润	0.0755	0.0010	-
本期基金份额净值增长率为	7.73%	0.1%	-
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	0.0067	0.0002	-
期末基金份额净值	171,695,567.41	220,822,181.61	-
期末基金份额净值	1.007	1.001	-

注: 1.上述基金业绩效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.期末可供分配利润即期末可供分配利润中未分配利润与未分配利润的孰低数(即:期末可供分配利润=期末可供分配利润中未分配利润与未分配利润孰低者)。
4.自基金合同生效日起至本报告期末, 基金运作时间未满三年。
5.以上财务指标系根据实际年度按期折算计算。

3.2 基金净值表现

本基金每份累计单位净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长 累计净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④
长短期基准差 ②-① ③-② ④-③
过去一个月 1.36% 0.13% -0.13% 0.02% 1.49% 0.11%
过去6个月 0.39% 0.12% -1.14% 0.04% 1.53% 0.08%
过去一年 7.73% 0.12% 0.37% 0.06% 7.36% 0.06%
成立以来 7.84% 0.12% 0.49% 0.06% 7.35% 0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计单位净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天治稳定收益债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图
2011年12月28日至2012年12月31日

图例: 天治稳定收益债券型证券投资基金
业绩比较基准
天治稳定收益债券型证券投资基金
2011年12月28日至2012年12月31日

图