# 天治稳健双盈债券型证券投资基金

## 【2013】半年度报告摘要

**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**
**报告送出日期：二〇一三年八月二十七日**

## 1 重要提示及目录

1.1 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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月26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应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

## 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 | 927,273,617.74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稳健收益。 |
| 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，运用自上而下的资产配置与品种选择策略，并充分利用各种套利策略，实现基金的保值增值。此外，本基金可以参与股票一级市场申购和二级市场投资。 |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为中证全债指数收益率。 |
| 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较低收益品种，其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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张丽红 | 李芳菲 |
| | 联系电话 | 021-60371155 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | zhanglh@chinanature.com.cn | lifangfei@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-098-4800(免长途通话费用)、021-60374800 | 95599 |
| 传真 | | 021-60374934 | 010-63201816 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址 | www.chinanature.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人的办公场所 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

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(2013年1月1日至2013年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 59,053,116.78 |
| 本期利润 | 24,612,318.11 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0445 |
| 本期基金份额净值增长率 | 11.02% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2013年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1969 |
| 期末基金资产净值 | 1,128,264,336.65 |
| 期末基金份额净值 | 1.2168 |

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、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孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

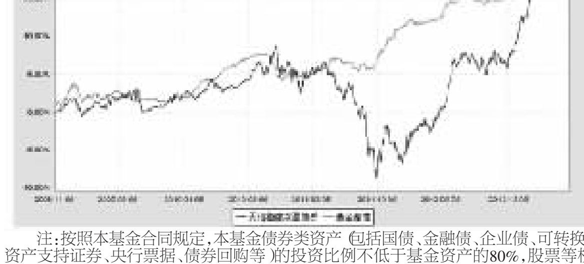
3.2 基金净值表现

3.2.1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

| 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 | -3.76% | 0.85% | -0.38% | 0.16% | -3.38% | 0.69% |
| 过去三个月 | 2.19% | 0.64% | 0.98% | 0.10% | 1.21% | 0.54% |
| 过去六个月 | 11.02% | 0.55% | 2.42% | 0.08% | 8.60% | 0.47% |
| 过去一年 | 14.18% | 0.44% | 2.84% | 0.07% | 11.34% | 0.37% |
| 过去三年 | 17.76% | 0.43% | 11.05% | 0.10% | 6.71% | 0.33% |
| 自基金成立起至今 | 21.68% | 0.36% | 18.03% | 0.12% | 3.65% | 0.24% |

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

天治稳健双盈债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2008年11月5日至2013年6月30日）



注：按照本基金合同规定，本基金债券类资产（包括国债、金融债、企业债、可转换债券、资产支持证券、央行票据、债券回购等）的投资比例不低于基金资产的80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，本基金持有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%。本基金自2008年11月5日基金合同生效日起六个月内，达到了本基金合同第12条规定的投资比例限制。

## 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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2013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—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）、天治天得利货币市场基金、天治创新先锋股票型证券投资基金、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、天治成长精选股票型证券投资基金、天治稳定收益债券型证券投资基金、天治可转债增强债券型证券投资基金的基金合同分别于2004年6月29日、2005年1月12日、2006年1月20日、2006年7月5日、2008年5月8日、2009年7月15日、2011年8月4日、2011年12月28日、2013年6月4日生效。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 秦娟 | 固定收益部总监、本基金的基金经理、天治稳定收益债券型证券投资基金的基金经理、天治可转债增强债券型证券投资基金的基金经理。 | 2010-04-14 | - | 9 | 经济学硕士研究生，具有基金从业资格，证券从业经验9年，历任广东证券股份有限公司债券分析师、东莞银行股份有限公司债券分析师、长信基金管理有限责任公司债券研究员，2010年4月14日至2012年6月29日任天治天得利货币市场基金的基金经理，现任本公司固定收益部总监、本基金的基金经理、天治稳定收益债券型证券投资基金的基金经理、天治可转债增强债券型证券投资基金的基金经理。 |

注：1、表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从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规守信情况的说明

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》等有关法律法规，除个别投资比例超标且已调整、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持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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涵盖授权、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，并通过明确投资权限划分、建立统一研究报告管理平台、分层次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相关程序、定期对不同投资组合收益率差异、交易价差、成交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 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说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年2月份开始，先行指标PMI数据出现滞涨，投资和工业增加值也没有延续2012年四季度的复苏格局。针对不断下行的经济数据，并未出现新一轮的经济刺激政策，管理层对经济增速下行的忍耐力提高，放权、结构优化和转型的政策意图显而易见。政策方面，"五号文"超预期地对地产调控，使得后续地产的复苏受到挑战，而限制"三公消费"使得内需数据也出现调整，季末银监会的"8号文"明显地对"影子银行"业务形成明显制约，之前拉动经济高速增长的基建增速在融资渠道方面受到影响。货币政策方面，5月份随着美联储QE3退出预期的增强，全球流动性出现了短期的波动，尤其是在5、6月份，货币市场资金面在外汇占款增量减少、季末因素以及央行没有大量投放资金的共振下，出现了罕见的"钱荒"，使得所有的资本品价格暴跌，尤其是流动性较好的国债、可转债以及银行和地产类的股票。大类资产方面，1季度，在资金面宽裕的情况下，低评级的信用债继续演绎出牛市的特征，债券方面，4、5月份城投债供小于需，使得收益率不断走低，6月份随着资金面的超级紧张，所有债券出现了暴跌，货币市场利率更是创出了历史新高。4、5月份在经济增速整体增长乏力和资金面相对宽松的情况下，许多成长股不断创出新高，创业板和中小板的走势尤其强势。6月份在流动性紧张的情况下，所有的股票出现了暴跌。

本基金上半年的权益类仓位较重，主要以TMT和环保为主。转债方面，大盘可转债民生转债、工行转债和石化转债的配置比重较重。纯债方面，主要以城投债和短期融资券为主。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期末，本基金份额净值为1.2168元，报告期内本基金份额净值增长率为11.02%，业绩比较基准收益率为2.42%，高于同期业绩比较基准收益率8.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年下半年，经济增速依然不能抱太大的期望，货币政策方面，紧平衡会继续贯彻执行，资本市场较大的不确定性在于美联储QE3的退出和IPO的重启。乐观的预期在于调结构会跟进一些具体政策，会促使股市的结构性机会延续。债券市场方面，经济增速的下行带动利率债收益率下行，但是紧平衡货币政策使得整体收益率曲线的中枢值提高，在此纠结中，债券的平衡市会延续，资本利得的获取比较难。

本基金下半年对于纯债的操作将主要以持有目前品种为主，在脉冲式的收益率上涨时会适度增加利率债的配置。转债方面，在目前的点位，将适度增加偏债类的转债、减少偏股型转债的仓位，以均衡配置为主。股票方面，继续降低前期获利较多的成长类股票，适当地参与估值较低的高端服务装备、地产产业链等相关行业的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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、合规，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了天治基金管理有限公司估值委员会（以下简称"估值委员会"），制定了有关议事规则。估值委员会成员包括公司投资决策委员会成员、负责基金结算的管理层、监察稽核部总监、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，与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值委员会。

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任何重大利益冲突。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

## 5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管天治稳健双盈债券型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《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托管协议》的约定，对天治稳健双盈债券型证券投资基金管理人—天治基金管理有限公司2013年1月1日至2013年6月30日基金的投资运作，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额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，天治基金管理有限公司在天治稳健双盈债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，除个别投资比例超标且已调整、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基金合同的规定进行。报告期内，本基金未进行利润分配。

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的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的天治稳健双盈债券型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1资产负债表

会计主体：天治稳健双盈债券型证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末<br>2013年6月30日 | 上年度末<br>2012年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 34,342,251.66 | 24,821,861.49 |
| 结算备付金 | | 4,862,000.69 | 933,249.17 |
| 存出保证金 | | 198,835.10 | 250,000.00 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,234,879,578.36 | 288,325,937.55 |
| 其中：股票投资 | 6.4.7.2 | 200,109,898.83 | 41,678,170.45 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | 6.4.7.2 | 1,034,769,679.53 | 246,647,767.10 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 6,373,520.87 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 10,368,161.36 | 6,512,150.79 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 7,096,260.15 | 2,435,123.77 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 1,291,747,087.32 | 329,651,843.64 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末<br>2013年6月30日 | 上年度末<br>2012年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 115,259,835.36 | 35,089,849.86 |
| 应付证券清算款 | | 18,020,668.37 | - |
| 应付赎回款 | | 26,010,414.58 | 5,228,517.87 |
| 应付管理人报酬 | | 736,585.87 | 211,609.21 |
| 应付托管费 | | 210,453.08 | 60,459.78 |
| 应付销售服务费 | | 315,679.65 | 90,689.67 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.6 | 1,572,972.30 | 233,310.91 |
| 应交税费 | | 901,722.00 | 225,722.00 |
| 应付利息 | | 108,774.88 | 24,030.35 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.7 | 345,644.58 | 301,203.69 |
| 负债合计 | | 163,482,750.67 | 41,465,393.34 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.8 | 927,273,617.74 | 262,950,771.01 |
| 未分配利润 | 6.4.7.9 | 200,990,718.91 | 25,235,679.29 |
| 所有者权益合计 | | 1,128,264,336.65 | 288,186,450.30 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,291,747,087.32 | 329,651,843.64 |

注：报告截止日2013年06月30日，基金份额净值1.2168元，基金份额总额927,273,617.74份。

6.2 利润表

会计主体：天治稳健双盈债券型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 32,026,644.25 | 8,274,908.38 |
| 1.利息收入 | | 9,392,084.25 | 1,204,288.62 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.10 | 187,572.73 | 32,947.25 |
| 债券利息收入 | | 9,152,517.08 | 1,149,079.95 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 51,994.44 | 22,261.42 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | 56,812,027.63 | 1,661,148.16 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.11 | 34,780,571.62 | -1,008,686.04 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 21,150,169.36 | 2,627,248.18 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.13 | 881,286.65 | 42,586.02 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以"-"号填列) | 6.4.7.14 | -34,440,798.67 | 5,381,439.77 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 6.4.7.15 | 263,331.04 | 28,031.83 |
| 减：二、费用 | | 7,414,326.14 | 921,413.35 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,297,616.97 | 238,921.25 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 656,461.96 | 68,263.20 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 984,692.94 | 102,394.87 |
| 4.交易费用 | 6.4.7.16 | 2,213,319.27 | 150,817.20 |
| 5.利息支出 | | 1,164,460.75 | 271,783.32 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,164,460.75 | 271,783.32 |
| 6.其他费用 | 6.4.7.17 | 97,774.25 | 89,233.51 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | 24,612,318.11 | 7,353,495.03 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | 24,612,318.11 | 7,353,495.03 |

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：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 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) | 262,950,771.01 | 25,235,679.29 | 288,186,450.30 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 24,612,318.11 | 24,612,318.11 |
| 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) | 664,322,846.73 | 151,142,721.51 | 815,465,568.24 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,820,351,767.20 | 381,842,365.39 | 2,202,194,132.59 |
| 2.基金赎回款 | -1,156,028,920.47 | -230,699,643.88 | -1,386,728,564.35 |
| 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) | 927,273,617.74 | 200,990,718.91 | 1,128,264,336.65 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 | | |
| | 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) | 60,135,888.41 | -3,403,605.74 | 56,732,282.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 7,353,495.03 | 7,353,495.03 |
| 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) | 158,779,928.68 | 10,425,691.77 | 169,205,620.45 |
| 其中：1.基金申购款 | 296,013,329.65 | 15,979,408.92 | 311,992,738.57 |
| 2.基金赎回款 | -137,233,400.97 | -5,553,717.15 | -142,787,118.12 |
| 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) | 218,915,817.09 | 14,375,581.06 | 233,291,398.15 |

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：赵玉彪，主管会计工作负责人：闫译文，会计机构负责人：尹维忠

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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"）证监许可［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人向社会公开发行募集，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。本基金为契约型开放式，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有限公司。

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允许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—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称"企业会计准则"）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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2013年06月30日的财务状况以及2013年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与2012年年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准，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‰调整为1‰；

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）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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。

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，继续免征营业税和企业所得税；

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［2008］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中取得的收入，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。

3.个人所得税

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、红利收入，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扣代缴20%的个人所得税；

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的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全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，暂减按25%计入应纳税所得额；

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个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字［2008］132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关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 关联方关系

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

经天治基金管理有限公司（简称"本公司"）股东会会议审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可［2013］261号文审核批准，本公司原股东吉林市国有资产经营有限责任公司将其持有的本公司12.50%股权转让给本公司股东吉林省信托有限责任公司。本次股权转让后，本公司股东变更为：吉林省信托有限责任公司、中国吉林森林工业集团有限责任公司。本公司已于2013年5月30日在中国证监会指定媒体及网站发布了《天治基金管理有限公司股权变更公告》。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 天治基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,297,616.97 | 238,921.25 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 541,560.12 | 25,526.40 |

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%/当年天数

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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 656,461.96 | 68,263.20 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.20%/当年天数

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.8.2.3销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 天治基金管理有限公司 | 98,960.91 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 138,611.75 |
| 合计 | 237,572.66 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 天治基金管理有限公司 | 55,204.52 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 27,881.39 |
| 合计 | 83,085.91 |

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。

在通常情况下，基金销售服务费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=E×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%

H为每日应计提的基金销售服务费

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等。

（2）若干比较数据已进行重述，以符合本年度之列报要求。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运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。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 34,342,251.66 | 162,723.18 | 44,166,332.78 | 30,194.17 |

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（2013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。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年06月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额29,759,835.36元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1280160 | 12惠投债 | 2013-07-04 | 101.51 | 310,000 | 31,468,100.00 |
| 合计 | | - | - | 310,000 | 31,468,100.00 |

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013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85,500,000.00元，于2013年7月2日、2013年7月3日（先后）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入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.10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

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 200,109,898.83 | 15.49 |
| | 其中：股票 | 200,109,898.83 | 15.49 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,034,769,679.53 | 80.11 |
| | 其中：债券 | 1,034,769,679.53 | 80.11 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 39,204,252.35 | 3.03 |
| 6 | 其他各项资产 | 17,663,256.61 | 1.37 |
| 7 | 合计 | 1,291,747,087.32 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 82,391,917.80 | 7.30 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 17,556,000.00 | 1.56 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 64,679,414.86 | 5.73 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 35,482,566.17 | 3.14 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 200,109,898.83 | 17.74 |

7.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300088 | 长信科技 | 1,478,059 | 31,172,264.31 | 2.76 |
| 2 | 000826 | 桑德环境 | 823,835 | 26,585,155.45 | 2.36 |
| 3 | 600048 | 保利地产 | 2,615,656 | 25,921,150.96 | 2.30 |
| 4 | 600340 | 华夏幸福 | 668,785 | 21,762,263.90 | 1.93 |
| 5 | 002375 | 亚厦股份 | 570,000 | 17,556,000.00 | 1.56 |
| 6 | 000024 | 招商地产 | 700,000 | 16,996,000.00 | 1.51 |
| 7 | 000012 | 南玻A | 1,429,710 | 13,253,411.70 | 1.17 |
| 8 | 002055 | 得润电子 | 1,205,300 | 12,354,325.00 | 1.09 |
| 9 | 002411 | 九九久 | 1,890,729 | 10,417,916.79 | 0.92 |
| 10 | 300115 | 长盈精密 | 300,000 | 9,642,000.00 | 0.85 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站www.chinanature.com.cn上的半年度报告全文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入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 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600048 | 保利地产 | 62,994,376.16 | 21.86 |
| 2 | 002241 | 歌尔声学 | 57,092,922.88 | 19.81 |
| 3 | 002456 | 欧菲光 | 47,988,909.23 | 16.65 |
| 4 | 002236 | 大华股份 | 47,602,528.05 | 16.52 |
| 5 | 000012 | 南玻A | 42,319,254.18 | 14.68 |
| 6 | 000826 | 桑德环境 | 38,457,845.50 | 13.34 |
| 7 | 002573 | 国电清新 | 33,810,285.14 | 11.73 |
| 8 | 600837 | 海通证券 | 30,285,847.94 | 10.51 |
| 9 | 300088 | 长信科技 | 28,936,619.18 | 10.04 |
| 10 | 002400 | 省广股份 | 26,560,749.42 | 9.22 |
| 11 | 000024 | 招商地产 | 25,724,974.41 | 8.93 |
| 12 | 002353 | 杰瑞股份 | 24,220,099.72 | 8.40 |
| 13 | 300212 | 易华录 | 22,177,284.54 | 7.70 |
| 14 | 300228 | 富瑞特装 | 21,355,992.63 | 7.41 |
| 15 | 600340 | 华夏幸福 | 20,989,191.00 | 7.28 |
| 16 | 002411 | 九九久 | 20,687,954.87 | 7.18 |
| 17 | 000783 | 长江证券 | 19,599,373.00 | 6.80 |
| 18 | 002064 | 华峰氨纶 | 17,193,212.68 | 5.97 |
| 19 | 000625 | 长安汽车 | 16,189,863.06 | 5.62 |
| 20 | 002375 | 亚厦股份 | 15,601,968.23 | 5.41 |
| 21 | 300017 | 网宿科技 | 13,978,447.14 | 4.85 |
| 22 | 000888 | 峨眉山A | 13,783,195.16 | 4.78 |
| 23 | 002410 | 广联达 | 12,784,477.64 | 4.44 |
| 24 | 002055 | 得润电子 | 12,027,904.89 | 4.17 |
| 25 | 600583 | 海油工程 | 11,682,383.89 | 4.05 |
| 26 | 002292 | 奥飞动漫 | 10,838,294.69 | 3.76 |
| 27 | 300241 | 瑞丰光电 | 9,553,323.40 | 3.31 |
| 28 | 000887 | 中鼎股份 | 9,020,536.70 | 3.13 |
| 29 | 300115 | 长盈精密 | 8,954,607.00 | 3.11 |
| 30 | 600518 | 康美药业 | 8,555,332.72 | 2.97 |
| 31 | 002457 | 青龙管业 | 8,542,420.18 | 2.96 |
| 32 | 300058 | 蓝色光标 | 8,287,798.40 | 2.88 |
| 33 | 600376 | 首开股份 | 7,575,000.89 | 2.63 |
| 34 | 000596 | 古井贡酒 | 6,084,294.09 | 2.11 |

注：表中"买入金额"按买入成交金额（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 | 002241 | 歌尔声学 | 72,729,392.52 | 25.24 |
| 2 | 002456 | 欧菲光 | 55,894,264.16 | 19.40 |
| 3 | 002236 | 大华股份 | 48,276,190.32 | 16.75 |
| 4 | 000012 | 南玻A | 35,333,392.66 | 12.26 |
| 5 | 600837 | 海通证券 | 33,790,096.97 | 11.73 |
| 6 | 600048 | 保利地产 | 32,939,252.32 | 11.43 |
| 7 | 002400 | 省广股份 | 28,360,956.95 | 9.84 |
| 8 | 002573 | 国电清新 | 28,138,139.92 | 9.76 |
| 9 | 002353 | 杰瑞股份 | 24,537,351.82 | 8.51 |
| 10 | 300228 | 富瑞特装 | 22,743,409.30 | 7.89 |
| 11 | 300212 | 易华录 | 22,497,810.26 | 7.81 |
| 12 | 000783 | 长江证券 | 18,669,684.54 | 6.48 |
| 13 | 300017 | 网宿科技 | 17,889,278.27 | 6.21 |
| 14 | 000625 | 长安汽车 | 13,977,966.26 | 4.85 |
| 15 | 000888 | 峨眉山A | 13,355,162.54 | 4.63 |
| 16 | 002410 | 广联达 | 12,836,754.39 | 4.45 |
| 17 | 600518 | 康美药业 | 12,550,865.09 | 4.36 |
| 18 | 000826 | 桑德环境 | 11,282,379.52 | 3.91 |
| 19 | 002064 | 华峰氨纶 | 11,219,244.45 | 3.89 |
| 20 | 600583 | 海油工程 | 11,170,222.46 | 3.88 |
| 21 | 600376 | 首开股份 | 10,716,908.93 | 3.72 |
| 22 | 300241 | 瑞丰光电 | 10,399,310.80 | 3.61 |
| 23 | 002292 | 奥飞动漫 | 10,025,646.05 | 3.48 |
| 24 | 300168 | 万达信息 | 9,625,132.05 | 3.34 |
| 25 | 000024 | 招商地产 | 8,977,037.50 | 3.12 |
| 26 | 300058 | 蓝色光标 | 8,952,727.23 | 3.11 |
| 27 | 000887 | 中鼎股份 | 8,788,602.36 | 3.05 |
| 28 | 002457 | 青龙管业 | 7,453,960.50 | 2.59 |
| 29 | 000568 | 泸州老窖 | 6,544,612.28 | 2.27 |
| 30 | 300088 | 长信科技 | 6,494,579.64 | 2.25 |
| 31 | 000596 | 古井贡酒 | 6,056,784.60 | 2.10 |

注：表中"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 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票的成本(成交)总额 | 814,451,177.47 |
| 卖出股票的收入(成交)总额 | 686,802,348.60 |

注：表中"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 48,125,826.00 | 4.27 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 29,898,000.00 | 2.65 |
| | 其中：政策性金融债 | 29,898,000.00 | 2.65 |
| 4 | 企业债券 | 289,814,000.00 | 25.69 |
| 5 | 企业短期融资券 | 128,920,000.00 | 11.43 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 538,011,853.53 | 47.68 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,034,769,679.53 | 91.71 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 110023 | 民生转债 | 1,033,300 | 107,411,535.00 | 9.52 |
| 2 | 110015 | 石化转债 | 1,039,050 | 103,717,971.00 | 9.19 |
| 3 | 113002 | 工行转债 | 861,810 | 94,264,777.80 | 8.35 |
| 4 | 041359040 | 13川铁投CP002 | 800,000 | 79,200,000.00 | 7.02 |
| 5 | 113003 | 重工转债 | 519,020 | 56,739,266.40 | 5.03 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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、处罚的情形。

7.9.2 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。

7.9.3期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 198,835.10 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 10,368,161.36 |
| 5 | 应收申购款 | 7,096,260.15 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 17,663,256.61 |

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110015 | 石化转债 | 103,717,971.00 | 9.19 |
| 2 | 113002 | 工行转债 | 94,264,777.80 | 8.35 |
| 3 | 113003 | 重工转债 | 56,739,266.40 | 5.03 |
| 4 | 110018 | 国电转债 | 49,440,800.00 | 4.38 |
| 5 | 110020 | 南山转债 | 43,749,589.90 | 3.88 |
| 6 | 113001 | 中行转债 | 38,198,972.70 | 3.39 |
| 7 | 125887 | 中鼎转债 | 22,998,845.33 | 2.04 |
| 8 | 110007 | 博汇转债 | 14,693,361.80 | 1.30 |
| 9 | 110017 | 中海转债 | 6,675,933.60 | 0.59 |
| 10 | 110016 | 川投转债 | 120,800.00 | 0.01 |

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6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。

## 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 15,702 | 59,054.49 | 73,552,983.94 | 7.93% | 853,720,633.80 | 92.07% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 82,806.06 | 0.009% |

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0；

（2）该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2008年11月5日)基金份额总额 | 787,576,971.03 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 262,950,771.01 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,820,351,767.20 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,156,028,920.47 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 927,273,617.74 |

## 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，无基金份额持有人大会决议。

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，经天治基金管理有限公司董事会审议通过，聘任常永涛先生担任公司副总经理职务。上述事项已按有关规定报中国基金业协会备案，本基金管理人2013年5月7日在指定媒体及公司网站上刊登了《天治基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

10.5报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内，未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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罚。

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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 招商证券 | 1 | 1,143,671,476.98 | 76.18% | 1,012,036.65 | 75.78% | - |
| 中信建投 | 1 | 276,931,860.26 | 18.45% | 252,120.12 | 18.88% | - |
| 华西证券 | 1 | 80,650,188.83 | 5.37% | 71,367.18 | 5.34% | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |

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：

（1）经营行为规范，近一年内无重大违规行为；

（2）公司财务状况良好；

（3）有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

（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特殊要求，提供专门的研究报告；

（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考察后，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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 招商证券 | 32,089,425.35 | 2.87% | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1,074,943,611.40 | 96.14% | 1,246,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 11,070,882.19 | 0.99% | - | - | - | - |

天治基金管理有限公司
二〇一三年八月二十七日