

## 天治核心成长股票型证券投资基金(LOF)

## [2013]第四季度报告

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:二〇一四年一月二十一日

## 5.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证所披露信息不存在虚假记载、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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

## 5.2 基金产品概况

基金简称 天治核心成长股票(LOF)

基金主代码 163503

交易代码 163503

基金运作方式 约定的上市开放式(LOF)

基金合同生效日 2006年1月20日

报告期末基金份额总额 3,946,821,399.38份

投资目标 通过充分资产投资于品质优良、成长潜力高于平均水平的中型上市公司股票,并将部分资产用于复制大型上市公司股票指数(富时中国A200指数)的业绩表现,在控制相对市场风险的前提下,追求长期的资本增值。

投资策略 本基金以股票为主要投资标的,以“核心+卫星”策略作为股票投资的总体策略,“核心+卫星”策略是指将股票资产分为核心组合和卫星组合,核心组合通过跟踪指数进行被动投资,控制投资组合相对于市场的风险;卫星组合通过优选股票进行主动投资,追求超越市场平均水平的收益。本基金的核心组合用以跟踪大型公司股票指数(富时中国A200指数),卫星组合用以优选中小型企业股票。

业绩比较基准 富时中国A股指数×75%+富时中国国债指数×25%。

风险收益特征 本基金具有中等风险,中高收益的股票型基金,风险收益特征介于大盘平衡型基金和小盘成长型基金之间。

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

## 5.3 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)

1.本期已实现收益 50,967,707.62

2.本期利润 -54,554,227.55

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0136

4.期末基金份额净值 2,310,318,104.15

5.期末基金资产净值 5,0854

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.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

注:按本基金合同规定,本基金资产配置中股票投资比例为基金净资产的60%~95%,其中,核心组合的投资比例为股票净资产的5%~65%,卫星组合的投资比例为股票净资产的3%~45%;债券投资比例为基金净资产的0%~40%,现金比例为基金净资产的5%~45%。本基金自2006年1月20日至报告期末,基金净值增长率日均收益率大于或等于同期业绩比较基准收益率变动的比较。

4.1 管理人报告

4.1.基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

秦海燕 基金经理,天治品质成长股票型证券投资基金基金经理 2010-12-31 - 7 理学硕士研究生,具有基金从业资格,证券从业经验7年,2006年6月加入天治基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理,现任本基金的基金经理、天治品质成长混合型证券投资基金的基金经理。

注:1.本基金的任期内和离任日期为公司作出认定之日起。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券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

在报告期内,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《天治核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》、《天治核心成长股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,诚信、审慎、勤勉尽责地履行基金财产管理职责,规范基金运作。本报告期内,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。

4.3.公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》和《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制度从投资决策、投资管理、交易行为、绩效评估等环节严格实施风险预警管理,在明确的风险预算目标范围内追求稳定的超额收益。

4.4.报告期未出现影响公平交易的重大事件

报告期内,本基金管理人所有的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。

4.5.公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人未发现有明显异常交易行为。

4.6.报告期内本基金的估值政策及结果说明

4.4.1.报告期内本基金投资组合运作分析

2013年四季度整体呈现下跌2.7%,沪深300下跌3.28%,中小板指数下跌4.96%,创业板指数下跌4.6%,虽然涨幅最大的是创业板,但是其有些行业仍有较好的表现,本季度中中信29个一级行业表现差距较大,其中涨幅最大的是汽车行业,涨幅最大的是传媒行业,下跌21.79%,本季度的结构性特征性行业对股市的影响较大,市场的改革预期达到了高潮,导致了市场的波动,再如,宣布IPO再次开放的信息,导致创业板等今年涨幅较大的个股在年内出现大幅回调,唯一单边下跌的则是市场一直担心的银行和地产等行业,所以市场的整体波动导致股价的波动较大。

4.6.2.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.3.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.4.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.5.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.6.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.7.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.8.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.9.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.10.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.11.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.12.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.13.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.14.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.15.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.16.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.17.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.18.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.19.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.20.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.21.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.22.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.23.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.24.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.25.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.26.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.27.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.28.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.29.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.30.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.31.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.32.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.33.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.34.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.35.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.36.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.37.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.38.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.39.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.40.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.41.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.42.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.43.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.44.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.45.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.46.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.47.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.48.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现对宏观经济、行业政策及市场走势有明显影响的情况。

4.6.49.报告期对宏观经济、行业政策及市场走势的专项说明

报告期内,本基金管理人未发现