

# 信息披露 Disclosure

## 天治稳健双盈债券型证券投资基金

### 2014第一季度报告

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:二〇一四年四月十九日

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证所披露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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

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2014年4月18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。

本报告中引用的财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

#### 5.2 基金产品概况

基金名称	天治稳健双盈债券
基金代码	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
报告期末基金份额总额	784,790,635.07

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理论收益。

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策略，通过定期调整组合久期，进而适时调整组合久期的波动幅度，在严格控制风险的前提下，实现基金的增值保值。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为货币市场基金收益率。

风险收益特征 本基金属中低风险收益的债券型基金，其预期收益水平低于股票型基金，高于货币市场基金。

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

#### 5.3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-23,571,736.19
2.本期利润	-19,715,570.37
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0251
4.期末基金份额净值	0.9993598.42
5.期末基金份额净值	1.1583

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。

3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.1 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 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值