

## 天治财富增长证券投资基金

## [2015] 第四季度报告

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月21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。

本报告为财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	天治财富增长混合
交易代码	360001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年6月29日
报告期末基金份额总额	79,200,426.69
投资目标	本基金的投资策略不直接涉及个股选择，而是通过行业配置、仓位调整、择时操作等方法来实现对不同类别的资产类别的风险收益特征的跟踪配置管理，力争在充分分析对各个资产类别的风险收益特征的基础上，寻求最大限度地降低基金资产的稳定性风险。
投资策略	本基金通过行业配置、仓位调整、择时操作等方法来实现对不同类别的资产类别的风险收益特征的跟踪配置管理，力争在充分分析对各个资产类别的风险收益特征的基础上，寻求最大限度地降低基金资产的稳定性风险。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中风险较低、收益稳健的基金品种。
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	16,360,349.79
2.本期利润	22,842,435.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.63218
4.期末基金份额净值	1.6479

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将低于所示数字。  
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 本基金报告期内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 净值增长率① 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

过去三个月 26.10% 1.86% 8.26% 0.66% 17.84% 1.20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

图：1. 上述图表展示了自基金成立以来的净值增长率与业绩比较基准收益率的对比情况，显示了基金的表现。

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
吴昊	本基金的基本基金经理。	2016年2月17日	-	5

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守信守情况的说明  
报告期内，本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《天治财富增长证券投资基金合同》，《天治财富增长证券投资基金招募说明书》的约定，本基金管理人勤勉尽责的履行管理职责，规范基金运作，保护基金份额持有人合法权益。本基金管理人通过不断规范法人治理结构和内部控制，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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《公平交易制度》，《跨证券交易所股票交易制度》，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的各个环节，并通过明确权限限制、建立统一研究报告管理平台、分层次建立适应本公司及各投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库、应用投资管理系统实现公平交易相关程序、定期对不同投资组合收益差异、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，本基金管理人不存在所有投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易或该证券当日成交量5%的情形。

4.4 报告期内基金的投研会议记录和表决情况说明

4.5 投资组合报告

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。

4.6 公平交易专题说明

4.6.1 基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。

4.6.2 其他资产构成

序号 代码 名称 金额(元)

1	存出保证金	246,026.92
2	应收证券清算款	783,376.70
3	应收股利	-
4	应收利息	369,826.36
5	应收申购款	363,896.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,763,134.45

4.6.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号 代码 证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1	110031	蓝筹转债	2,506,800.00	2.12
---	--------	------	--------------	------

4.6.4 报告期末十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

4.6.5 投资组合报告对其他项目的描述部分

由于四五五人的原因，部分之和与合计可能存在偏差。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1	权益投资	82,298,014.45	59.06
2	其中：股票	82,298,014.45	59.06
3	固定收益投资	31,710,200.00	22.76
4	其中：债券	31,710,200.00	22.76
5	货币市场基金	-	-
6	应收银行存款	-	-
7	应收利息	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	应收手续费净额	23,587,595.60	1.69
7	其他资产	1,763,134.45	1.26
8	合计	139,349,011.40	100.00

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将低于所示数字。

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 本基金报告期期末基金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

阶段 净值增长率① 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

过去三个月 32.21% 2.42% 12.39% 1.17% 19.82% 1.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

图：1. 上述图表展示了自基金成立以来的净值增长率与业绩比较基准收益率的对比情况，显示了基金的表现。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

4.1.1 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。

4.1.2 其他资产构成

序号 代码 名称 金额(元)

1	存出保证金	246,026.92
2	应收证券清算款	783,376.70
3	应收股利	-
4	应收利息	369,826.36
5	应收申购款	363,896.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,763,134.45

4.1.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号 代码 证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1	110031	蓝筹转债	2,506,800.00	2.12
---	--------	------	--------------	------

4.1.4 报告期末十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

4.1.5 投资组合报告对其他项目的描述部分

由于四五五人的原因，部分之和与合计可能存在偏差。

4.2 公平交易专题说明

4.2.1 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《公平交易制度》，《跨证券交易所股票交易制度》，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的各个环节，并通过明确权限限制、建立统一研究报告管理平台、分层次建立适应本公司及各投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库、应用投资管理系统实现公平交易相关程序、定期对不同投资组合收益差异、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执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

4.2.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人不存在所有投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易或该证券当日成交量5%的情形。

4.3 公平交易专项说明

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《天治财富增长证券投资基金合同》，《天治财富增长证券投资基金招募说明书》的约定，本基金管理人勤勉尽责的履行管理职责，规范基金运作，通过不断规范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。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。