

天治核心成长股票型证券投资基金(LOF)

[2014] 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:2015年1月20日

§ 1 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年1月19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，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	天治核心成长股票(LOF)
场内简称	天治核心
交易代码	163603
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2006年1月20日
报告期末基金份额总额	3,194,844,204.07份
报告期内基金净值	天治核心
基金总资产	2,196,601,463.61元
报告期末基金份额净值	0.6997

注: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.基金净值是指基金资产总值除以基金份额净值。

4.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年10月1日—2014年12月31日)
1.本期已实现收益	249,368,766.75
2.期初利润	429,372,506.65
3.报告期内平均基金份额利润	0.1269
4.期末基金份额净值	2,196,601,463.61
5.期末基金份额总额	0.6997

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.基金净值是指基金资产总值除以基金份额净值。

4.基金通过不断完善基金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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度执行的情况

报告期内，本基金管理人严格执行《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)基金招募说明书》、《天治核心成长股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过对不断完善基金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。

4.3.2 公平交易制度执行的专项说明

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时反向交易的情形，未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同时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。

4.4 公告期内基金的业绩表现

4.4.1 公告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.4.2 公告期内基金的净值表现

4.4.3 公告期内基金的资产配置情况

4.4.4 公告期内基金的业绩表现说明

4.4.5 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5 公告期内基金的资产配置情况

4.5.1 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.2 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.3 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.4 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.5 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.6 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.7 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.8 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.9 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.10 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.11 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.12 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.13 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.14 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.15 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.16 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.17 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.18 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.19 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.20 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.21 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.22 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.23 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.24 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.25 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.26 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.27 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.28 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.29 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.30 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.31 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.32 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.33 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.34 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.35 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.36 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.37 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.38 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.39 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.40 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.41 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.42 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.43 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.44 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.45 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.46 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。

4.5.47 公告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金管理人运用固定收益类资产申购赎回，赎回或买卖基金。