

## 天治财富增长证券投资基金

[2014] 第四季度报告

重要提示

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  
报告送出日期:2015年1月20日

§ 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、完整性和及时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当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	天治财富增长混合
交易代码	350001
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	184,591,871.38份

投资目标 在确保基金财产安全的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。

投资策略 基金将建立定期时间轴以负债增长的动态资产配置模型，以投资保险策略、VaR(Value at Risk)技术为工具，对风险性资产（股票）和固定收益类资产（债券）的投资比例进行动态调整，并通过定期时间轴的滚动风险预算，力争使基金静态净值高于动态资产配置模型的预期收益。

投资策略 在风险控制的框架下，本基金通过积极投资，谋求基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准 中信标普300指数×40%+中债新全债指数×60%。

风险收益特征 本基金属于股票型基金中风险较低、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 主要财务指标和基金净值表现

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 26,583,028.52

2.本期利润 48,237,307.19

3.加权平均基金份额本期利润 0.2418

4.期末基金份额净值 201,711,382.36

5.期末基金资产净值 1,0927

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=基金资产净值/基金份额总数。

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 ①-③ ②-④

过去三个月 29.19% 1.51% 21.80% 0.89% 7.39% 0.62%

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

图示：基金成立以来净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

注：按照本基金合同规定，本基金在资产配置中股票投资比例范围为基金资产净值的0~70%，债券投资比例范围为基金资产净值的20%~100%。

§ 4 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间 证券从业年限 说明

周雷军 基金经理、天治财富增长证券投资基金基金经理 2012年6月29日 - 7 金融学专业硕士研究生，具有基金从业资格，现任本公司金融部总经理兼基金经理，具备丰富的基金投资管理经验。

1. 表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。  
4.2 管理人对报告期内本基金运作的说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及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取利益。本基金管理人通过不断完善基金运作机制，加强内部控制管理，规范基金运作。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 平等交易原则的执行情况

报告期内，基金管理人严格按照《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》，《公平交易监控制度报告书》。基金管理人平易交易体系涵盖研究、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，并通过明确投资权限划分、建立统一研究报告告管平台、分层次次建立公司及各投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库、设立投资监督平台、定期对不同投资组合收益率差异、交易误差、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，本基金运作情况良好，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，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与该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%的情况。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 报告期内本基金的资信情况说明

4.4.1 报告期内本基金的运作情况说明

报告期内，本基金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。

4.4.2 报告期内本基金的业绩表现

本基金的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.5 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 225,233.31

2 应收证券清算款 3,353,109.84

3 应收股利 -

4 应收利息 934,572.59

5 应收申购款 153,769.52

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 4,666,685.26

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元)

1 权益投资 134,433,151.73 58.87

其中：股票 134,433,151.73 58.87

2 固定收益投资 78,699,594.60 34.46

其中：债券 78,699,594.60 34.46

3 货币市场基金 -

4 金融衍生品投资 -

5 其他资产 78,699,594.60 34.46

6 银行存款和结算准备金合计 10,577,045.80 4.63

7 其他资产 4,666,685.26 2.04

8 合计 228,366,477.39 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 采矿业 - -

3 制造业 33,371,743.28 16.54

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 30,016,814.04 14.88

5 批发和零售业 - -

6 交通运输、仓储和邮政业 - -

7 餐饮和住宿业 199,840.00 0.10

8 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

9 金融业 11,824,880.00 5.86

10 房地产业 59,019,874.41 29.26

11 公用事业 - -

12 计算机、通信和其他电子设备制造业 - -

13 交通运输设备制造业 - -

14 化工、石油及制品、塑料、橡胶和塑料制品业 - -

15 电气机械、器材及设备制造业 - -

16 仪器仪表、工业自动化控制系统及其他电子设备制造业 - -

17 金属制品、机械和设备修理业 - -

18 其他制造业 - -

19 其他服务业 - -

20 其他 - -

21 其他 - -

22 其他 - -

23 其他 - -

24 其他 - -

25 其他 - -

26 其他 - -

27 其他 - -

28 其他 - -

29 其他 - -

30 其他 - -

31 其他 - -

32 其他 - -

33 其他 - -

34 其他 - -

35 其他 - -

36 其他 - -

37 其他 - -

38 其他 - -

39 其他 - -

40 其他 - -

41 其他 - -

42 其他 - -

43 其他 - -

44 其他 - -

45 其他 - -

46 其他 - -

47 其他 - -

48 其他 - -

49 其他 - -

50 其他 - -

51 其他 - -

52 其他 - -

53 其他 - -

54 其他 - -

55 其他 - -

56 其他 - -

57 其他 - -

58 其他 - -

59 其他 - -

60 其他 - -

61 其他 - -

62 其他 - -

63 其他 - -

64 其他 - -

65 其他 - -

66 其他 - -

67 其他 - -

68 其他 - -

69 其他 - -

70 其他 - -