

天治稳健双盈债券型证券投资基金

[2016] 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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2017年1月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理等人员声明:本基金不存在虚假记载、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、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合同规定,于2017年1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,保函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信信用、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2016年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金的名称		
天治稳健双盈债券型证券投资基金		
基金简称		
交易代码		
初始开放日		
最近收益公告日		
报告期基金净值总额		
报告期基金总资产和净资产值		
基金的投资目标		
投资策略		
业绩比较基准		
风险收益特征		
基金管理人		
基金托管人		

§ 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					
1.本期已实现收益					
2.本期利润					
3.加权平均基金份额本期利润					
4.期末基金资产净值					
5.期末基金份额净值					

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 本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	净值增长率为	净值增长率为	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-2.69%	0.21%	-1.79%	0.10%	-0.0%

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



§ 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
王洋	基金经理	2016年2月17日	-	9

注1:表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。

2.证券从业的含义是指从行业协会(证券业从业人员资格管理)的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

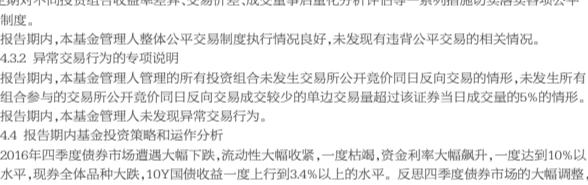
在本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《天治稳健双盈债券型证券投资基金基金合同》、《天治稳健双盈债券型证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

3.2.3 基金的业绩表现

3.2.3.1 本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	净值增长率为	净值增长率为	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-4.0%	0.0%	0.0%	0.0%	-4.0%

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



§ 4 管理人报告

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,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,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的交易所公开竞价同日反向交易量较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。			
4.3.3 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。			

4.3.4 公平交易专项说明

4.3.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.4.2 异常交易行为的专项说明

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日反向交易的情形,未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易量较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.3.4.3 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.4.4 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.5 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.6 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.7 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.8 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.9 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.10 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.11 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.12 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.13 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.14 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.15 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.16 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.17 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.18 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.19 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.20 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.21 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.22 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.23 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.24 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.25 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.26 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.27 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.28 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.29 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.30 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.31 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.32 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.33 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.34 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.35 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.36 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.37 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.38 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.39 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。

4.3.40 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.41 投资组合报告期内基金没有出现异常交易行为。