

## 天治财富增长证券投资基金

[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:上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人承诺以诚实信用、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。

报告书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

序号	代码	基金名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300336	债券型	240,000	6,840,000.00	10.6%
2	300337	股票型	600,000	6,296,000.00	10.2%
3	300338	债券型	600,000	6,296,000.00	10.2%
4	300339	债券型	600,000	6,297,000.00	10.2%
5	300340	债券型	38,000	1,089,300.00	2.2%
6	300340	债券型	360,000	1,786,000.00	3.2%
7	300340	债券型	26,000	1,786,000.00	2.2%
8	300340	债券型	110,000	1,726,000.00	2.1%
9	300340	债券型	100,000	1,661,000.00	2.1%
10	300341	债券型	120,000	1,648,000.00	2.0%

## § 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	32,967,760.00	56.2%
2	企业债	—	—
3	金融债	4,027,500.00	6.2%
4	公司债	4,027,500.00	6.2%
5	中小企业集合债	—	—
6	企业债	—	—
7	可转换债	1,794,360.00	2.2%
8	可分离债	—	—
9	信用债	—	—
10	合计	59,700,230.00	24.0%

## § 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100029	10国债11	50,000	4,003,500.00	6.31%
2	100424	10国开19	50,000	4,977,000.00	6.2%
3	000312	03国债9	40,000	4,070,000.00	5.1%
4	000307	21国债07	37,000	3,954,260.00	4.9%
5	120001	国债	8,000	100,260.00	1.2%

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2016年10月11日 - 2016年12月31日)		本期
1.本期利润	3,799,320.00	
2.本期利润	-5,548,300.00	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0043	
4.期末基金资产净值	79,023,160.00	
5.期末基金份额净值	1.0000	

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。

3.报告期末，本基金利润为零。

4.报告期末，本基金没有持有股票。

5.报告期末，本基金没有持有股票。

6.报告期末，本基金没有持有股票。

7.报告期末，本基金没有持有股票。

8.报告期末，本基金没有持有股票。

9.报告期末，本基金没有持有股票。

10.报告期末，本基金没有持有股票。

11.报告期末，本基金没有持有股票。

12.报告期末，本基金没有持有股票。

13.报告期末，本基金没有持有股票。

14.报告期末，本基金没有持有股票。

15.报告期末，本基金没有持有股票。

16.报告期末，本基金没有持有股票。

17.报告期末，本基金没有持有股票。

18.报告期末，本基金没有持有股票。

19.报告期末，本基金没有持有股票。

20.报告期末，本基金没有持有股票。

21.报告期末，本基金没有持有股票。

22.报告期末，本基金没有持有股票。

23.报告期末，本基金没有持有股票。

24.报告期末，本基金没有持有股票。

25.报告期末，本基金没有持有股票。

26.报告期末，本基金没有持有股票。

27.报告期末，本基金没有持有股票。

28.报告期末，本基金没有持有股票。

29.报告期末，本基金没有持有股票。

30.报告期末，本基金没有持有股票。

31.报告期末，本基金没有持有股票。

32.报告期末，本基金没有持有股票。

33.报告期末，本基金没有持有股票。

34.报告期末，本基金没有持有股票。

35.报告期末，本基金没有持有股票。

36.报告期末，本基金没有持有股票。

37.报告期末，本基金没有持有股票。

38.报告期末，本基金没有持有股票。

39.报告期末，本基金没有持有股票。

40.报告期末，本基金没有持有股票。

41.报告期末，本基金没有持有股票。

42.报告期末，本基金没有持有股票。

43.报告期末，本基金没有持有股票。

44.报告期末，本基金没有持有股票。

45.报告期末，本基金没有持有股票。

46.报告期末，本基金没有持有股票。

47.报告期末，本基金没有持有股票。

48.报告期末，本基金没有持有股票。

49.报告期末，本基金没有持有股票。

50.报告期末，本基金没有持有股票。

51.报告期末，本基金没有持有股票。

52.报告期末，本基金没有持有股票。

53.报告期末，本基金没有持有股票。

54.报告期末，本基金没有持有股票。

55.报告期末，本基金没有持有股票。

56.报告期末，本基金没有持有股票。

57.报告期末，本基金没有持有股票。

58.报告期末，本基金没有持有股票。

59.报告期末，本基金没有持有股票。

60.报告期末，本基金没有持有股票。

61.报告期末，本基金没有持有股票。

62.报告期末，本基金没有持有股票。

63.报告期末，本基金没有持有股票。

64.报告期末，本基金没有持有股票。

65.报告期末，本基金没有持有股票。

66.报告期末，本基金没有持有股票。

67.报告期末，本基金没有持有股票。

68.报告期末，本基金没有持有股票。

69.报告期末，本基金没有持有股票。

70.报告期末，本基金没有持有股票。

71.报告期末，本基金没有持有股票。

72.报告期末，本基金没有持有股票。

73.报告期末，本基金没有持有股票。

74.报告期末，本基金没有持有股票。

75.报告期末，本基金没有持有股票。

76.报告期末，本基金没有持有股票。

77.报告期末，本基金没有持有股票。

78.报告期末，本基金没有持有股票。

79.报告期末，本基金没有持有股票。

80.报告期末，本基金没有持有股票。

81.报告期末，本基金没有持有股票。

82.报告期末，本基金没有持有股票。

83.报告期末，本基金没有持有股票。

84.报告期末，本基金没有持有股票。

85.报告期末，本基金没有持有股票。

86.报告期末，本基金没有持有股票。

87.报告期末，本基金没有持有股票。

88.报告期末，本基金没有持有股票。

89.报告期末，本基金没有持有股票。

90.报告期末，本基金没有持有股票。

91.报告期末，本基金没有持有股票。

92.报告期末，本基金没有持有股票。

93.报告期末，本基金没有持有股票。

94.报告期末，本基金没有持有股票。

95.报告期末，本基金没有持有股票。

96.报告期末，本基金没有持有股票。

97.报告期末，本基金没有持有股票。

98.报告期末，本基金没有持有股票。

99.报告期末，本基金没有持有股票。

100.报告期末，本基金没有持有股票。

101.报告期末，本基金没有持有股票。

102.报告期末，本基金没有持有股票。

103.报告期末，本基金没有持有股票。

104.报告期末