

## 天治财富增长证券投资基金

[2017] 第一季度报告

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4月21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2017年4月18日复核了本报告中的财务数据、净值数据、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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3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 395001

基金运作方式 灵活的封闭式

基金合同生效日 2004年6月20日

报告期末基金份额总额 74,267,118.36份

投资目标 在本基金份额净值不低于本基金建立的动态资产保障线的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金在严格控制非保本的动态资产保障线的前提下，以投资组合保险策略、VaR Value at Risk技术为工具，对风险资产（股票）和低风险资产（债券）的投资比例进行动态调整，并结合合理的资产配置，力争在控制风险的前提下，获得超越业绩基准的收益。

基金合同生效以来基金资产净值的复合增长率为40.4%+中证全债指数收益率×60%。

基金净值增长率见基金管理人根据本基金定期报告所披露的净值增长率。

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。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 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( 2017年1月1日 - 2017年3月31日 )

1.本期已实现收益 906,397.02

2.本期利润 4,222,678.05

3.期初平均基金份额利润 0.0567

4.期末基金份额净值 72,764,810.65

5.期末基金份额总额 0.0768

注:1.上述基金业报酬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，余额为正时为本期已实现收益，余额为负时为本期已实现亏损。

3.基金净值表现

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的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去一个月 6.40% 0.2% 6.18% 0.21% 6.84% 0.051%

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期( 2017年1月1日 - 2017年3月31日 )

1.本期已实现收益 906,397.02

2.本期利润 4,222,678.05

3.期初平均基金份额利润 0.0567

4.期末基金份额净值 72,764,810.65

5.期末基金份额总额 0.0768

注:1.上述基金业报酬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，余额为正时为本期已实现收益，余额为负时为本期已实现亏损。

3.基金净值表现

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的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去一个月 6.40% 0.2% 6.18% 0.21% 6.84% 0.051%

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期( 2017年1月1日 - 2017年3月31日 )

1.本期已实现收益 906,397.02

2.本期利润 4,222,678.05

3.期初平均基金份额利润 0.0567

4.期末基金份额净值 72,764,810.65

5.期末基金份额总额 0.0768

注:1.上述基金业报酬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，余额为正时为本期已实现收益，余额为负时为本期已实现亏损。

3.基金净值表现

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的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去一个月 6.40% 0.2% 6.18% 0.21% 6.84% 0.051%

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期( 2017年1月1日 - 2017年3月31日 )

1.本期已实现收益 906,397.02

2.本期利润 4,222,678.05

3.期初平均基金份额利润 0.0567

4.期末基金份额净值 72,764,810.65

5.期末基金份额总额 0.0768

注:1.上述基金业报酬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，余额为正时为本期已实现收益，余额为负时为本期已实现亏损。

3.基金净值表现

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的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去一个月 6.40% 0.2% 6.18% 0.21% 6.84% 0.051%

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期( 2017年1月1日 - 2017年3月31日 )

1.本期已实现收益 906,397.02

2.本期利润 4,222,678.05

3.期初平均基金份额利润 0.0567

4.期末基金份额净值 72,764,810.65

5.期末基金份额总额 0.0768

注:1.上述基金业报酬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，余额为正时为本期已实现收益，余额为负时为本期已实现亏损。

3.基金净值表现

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的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去一个月 6.40% 0.2% 6.18% 0.21% 6.84% 0.051%

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期( 2017年1月1日 - 2017年3月31日 )

1.本期已实现收益 906,397.02

2.本期利润 4,222,678.05

3.期初平均基金份额利润 0.0567

4.期末基金份额净值 72,764,810.65

5.期末基金份额总额 0.0768

注:1.上述基金业报酬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，余额为正时为本期已实现收益，余额为负时为本期已实现亏损。

3.基金净值表现

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的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去一个月 6.40% 0.2% 6.18% 0.21% 6.84% 0.051%

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期( 2017年1月1日 - 2017年3月31日 )

1.本期已实现收益 906,397.02

2.本期利润 4,222,678.05

3.期初平均基金份额利润 0.0567

4.期末基金份额净值 72,764,810.65

5.期末基金份额总额 0.0768

注:1.上述基金业报酬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，余额为正时为本期已实现收益，余额为负时为本期已实现亏损。

3.基金净值表现

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的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去一个月 6.40% 0.2% 6.18% 0.21% 6.84% 0.051%

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期( 2017年1月1日 - 2017年3月31日 )

1.本期已实现收益 906,397.02

2.本期利润 4,222,678.05

3.期初平均基金份额利润 0.0567

4.期末基金份额净值 72,764,810.65

5.期末基金份额总额 0.0768

注:1.上述基金业报酬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，余额为正时为本期已实现收益，余额为负时为本期已实现亏损。

3.基金净值表现

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的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去一个月 6.40% 0.2% 6.18% 0.21% 6.84% 0.051%

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期( 2017年1月1日 - 2017年3月31日 )

1.本期已实现收益 906,397.02

2.本期利润 4,222,678.05

3.期初平均基金份额利润 0.0567

4.期末基金份额净值 72,764,810.65

5.期末基金份额总额 0.0768

注:1.上述基金业报酬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，余额为正时为本期已实现收益，余额为负时为本期已实现亏损。

3.基金净值表现

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的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去一个月 6.40% 0.2% 6.18% 0.21% 6.84% 0.051%

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期( 2017年1月1日 - 2017年3月31日 )

1.本期已实现收益 906,397.02