

# 天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书

## （摘要）（2016年第2次更新）

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

### 重要提示

天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）于2005年8月3日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2005]134号文核准公开募集。

本基金的基金合同于2006年1月20日正式生效。

投资有风险，投资者拟申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要依据基金合同和招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本次更新的招募说明书已经本基金托管人交通银行股份有限公司复核，除特别说明外，本次更新的招募说明书所载内容截止日为2016年7月20日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月30日（财务数据未经审计）。

### 一、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

- 1、名称：天治基金管理有限公司
- 2、住所：上海市浦东新区莲振路298号4号楼231室
- 3、成立日期：2003年5月27日

- 4、法定代表人：赵玉彪
- 5、办公地址：上海市复兴西路 159 号
- 6、电话：021-60371155
- 7、联系人：尹维忠
- 8、注册资本：1.6 亿元人民币
- 9、股权结构：吉林省信托有限责任公司出资 9800 万元，占注册资本的 61.25%；中国吉林森林工业集团有限责任公司出资 6200 万元，占注册资本的 38.75%。

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事、监事、经理层成员

吕文龙先生：董事长，研究生学历，曾任吉林省人民银行金融管理处办事员、科员、副处长，吉林省人民银行银行处副处长，吉林省人民银行外汇管理处副处长，吉林省人民银行非银行处副处长，中国证监会长春特派办机构处处长、稽查处处长，中国证监会吉林监管局期货处处长，吉林省信托投资有限责任公司总经理助理，现任吉林省信托有限责任公司党委委员、副总经理。

赵玉彪先生：副董事长，博士，历任吉林省信托有限责任公司上海证券业务部交易部经理、吉林省信托有限责任公司上海洪山路证券营业部经理兼驻上海证券交易所上市代表、上海金路达投资管理有限公司总经理、天治基金管理有限公司董事长、总经理，现任天治基金管理有限公司副董事长。

柏广新先生：董事，博士，高级经济师，历任吉林省黄泥河林业局副局长、党委书记，中共吉林省延边朝鲜族自治州委员会宣传部常务副部长，延边州人民政府副秘书长，延边州林业管理局局长兼吉林延边林业集团董事长，现任吉林森工集团有限责任公司董事长、党委书记，全国人大代表。

常永涛先生：董事，总经理，学士，历任四川省信托投资公司上海证券总部副总经理、大成基金管理公司交易员、基金经理助理、基金经理、申万巴黎基金管理公司基金经理、投资部总经理，2009 年起就职于天治基金管理有限公司，现任天治基金管理有限公司总经理。

武雷先生：独立董事，学士，历任北京市政府对外服务办公室、北京市金杜律师事务所律师、北京市金杜律师事务所上海分所合伙人，现任君合律师事务所上海分所合伙人。

陶武平先生：独立董事，研究生、硕士学位，历任上海市司法学校教务科科长、上海市联合律师事务所专职律师、上海市浦东涉外律师事务所专职律师、现任上海市申达律师事务所法定代表人及首席合伙人。

王明义先生：独立董事，研究生，曾任通化市矿务局工程处段长、吉林省白山市

房产局技术员、建设银行白山市支行科长、中国银行白山市支行副行长、中国平安保险公司白山支公司总经理、现任吉林省保险行业协会中介部主任，现已退休。

侯丹宇女士：监事会主席（职工监事），学士，历任吉林省信托有限责任公司上海证券业务部营业部经理、东北证券有限责任公司上海洪山路证券营业部总经理、天治基金管理有限公司督察长、副总经理，现任天治基金管理有限公司监事会主席（职工监事）。

邱荣生先生：监事，研究生学历，高级经济师，历任吉林省财政厅预算处科员、科长、副处长，香港振兴投资公司副总经理，吉林省财政厅副主任，吉林省信托有限责任公司工作办公室主任、财务部经理、总经理助理、副总经理、公司党委副书记、董事、总经理，现已退休。

姚世家先生：监事，硕士，高级会计师，曾任吉林省天桥岭林业局太阳林场财务处会计、处长、吉林省天桥岭林业局总会计师、副局长、局长、吉林省敦化市林业局局长、吉林省敦化市市长，现任中国吉林森林工业集团有限责任公司副总经理。

许家涵先生：职工监事，经济学、商务英语双学士，2007年起就职于天治基金管理有限公司，现任天治基金管理有限公司权益投资部总监。

尹维忠先生：职工监事，经济学硕士，2005年起就职于天治基金管理有限公司，现任天治基金管理有限公司总经理助理兼监察稽核部总监。

刘伟先生：督察长，学士，历任吉林省信托有限责任公司星火项目处项目负责人、自营基金业务部副经理、上海全路达创业投资公司董事长，现任天治基金管理有限公司督察长。

闫译文女士：副总经理，吉林大学法学硕士，高级经济师，注册会计师，曾就职于吉林省信托有限责任公司，任下属公司财务主管、公司行政主管、业务部经理、党委委员、职工董事等职务，现任天治基金管理有限公司副总经理、天治资产管理有限公司风险控制委员会成员。

## 2、本基金基金经理

许家涵先生：经济学、文学双学士，具有基金从业资格，证券从业经验11年。2005年7月至2007年9月就职于吉林省信托有限责任公司任自营资金部职员，2007年9月至今就职于天治基金管理有限公司，历任交易员、交易部总监助理、交易部副总监、交易部总监，现任权益投资部总监，2015年6月2日起任本基金的基金经理。

本基金历任基金经理：2006年1月20日（基金合同生效日）至2008年10月

31日，余明元先生任基金经理；2006年9月14日至2007年4月12日，吴鹏先生任基金经理；2008年4月11日至2011年9月9日，吴涛先生任基金经理。

2010年12月31日起至2015年6月12日，秦海燕女士任基金经理。

### 3、投资决策委员会成员

2015年10月9日，投资决策委员会成员调整为：公司总经理兼投资总监常永涛先生，权益投资部总监兼天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理许家涵先生，研究发展部总监、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金兼天治成长精选混合型证券投资基金的基金经理尹维国，固定收益部总监、天治稳健双盈债券型证券投资基金、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金兼天治可转债增强债券型证券投资基金的基金经理王洋。

4、上述人员之间无亲属关系。

## 二、基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.62亿元

法定代表人：牛锡明

联系人：汤嵩彦

电话：95559

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

天治基金管理有限公司直销中心

住所：上海市浦东新区莲振路298号4号楼231室

办公地址：上海市复兴西路159号

法定代表人：赵玉彪

电话：021-60371155

传真：021-60374934

联系人：王珊珊、韩涵

客户服务电话：400-098-4800（免长途通话费用）、021-34064800

网址: [www.chinanature.com.cn](http://www.chinanature.com.cn)

电子直销: 天治基金网上交易平台“E 天网”

网址: <https://etrade.chinanature.com.cn/>

## 2、代销机构

### (1) 交通银行股份有限公司

住所: 上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人: 牛锡明

电话: 021-58781234

传真: 021-58408483

联系人: 张宏革

客户服务电话: 95559

网址: [www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

### (2) 中国建设银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼(长安兴融中心)

法定代表人: 王洪章

电话: 010-66275654

传真: 010-66275654

联系人: 王琳

客户服务电话: 95533

网址: [www.ccb.com](http://www.ccb.com)

### (3) 中国农业银行股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人: 蒋超良

传真: 010-85109219

联系人: 熊奎

客户服务电话: 95599

网址: [www.abchina.com](http://www.abchina.com)、[www.95599.cn](http://www.95599.cn)

### (4) 兴业银行股份有限公司

住所: 福州市湖东路 154 号

办公地址: 上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

电话：021-62677777

联系人：刘玲

客户服务电话：95561

网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

（5）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：倪苏云

客户服务电话：95528

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

（6）中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

电话：010-65558888

传真：010-65550827

联系人：郭伟

客户服务电话：95558

网址：[www.bank.ecitic.com](http://www.bank.ecitic.com)

（7）中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

电话：010-57092615

传真：010-57092611

联系人：杨成茜

客户服务电话：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

（8）上海银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

电话：021-68475888

传真：021-68476111

联系人：汤征程

客户服务电话：95594

网址：[www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

(9) 北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街甲 17 号 8 层

法定代表人：闫冰竹

电话：010-66223584

传真：010-66226045

联系人：王曦

客户服务电话：95526

网址：<http://www.bankofbeijing.com.cn>

(10) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

电话：010-66568430

传真：010-66568990

联系人：田薇、宋明

客户服务电话：4008888888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(11) 国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺、朱雅崴

客户服务电话：95521

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(12) 海通证券股份有限公司

住所：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦  
办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦  
法定代表人：王开国  
电话：021-23219000  
联系人：李笑鸣  
客户服务电话：95553、4008888001  
网址：www.htsec.com

(13) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市安立路 66 号 4 号楼  
办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号  
法定代表人：王常青  
电话：010-85130544  
联系人：权唐  
客户服务电话：400-8888-108  
网址：www.csc108.com

(14) 申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层  
办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层  
法定代表人：李梅  
电话：021-33389888  
传真：021-33388224  
联系人：黄莹  
客户服务电话：95523 或 4008895523  
网址：www.swhysc.com

(15) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层  
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层  
法定代表人：宫少林  
电话：0755-82943666  
传真：0755-83734343  
联系人：林生迎  
客户服务电话：95565、4008881111



网址: [www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(16) 兴业证券股份有限公司

住所: 福建省福州市湖东路 268 号

办公地址: 上海市浦东民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 20 层

法定代表人: 兰荣

电话: 0591-38507679

联系人: 雷宇钦

客户服务电话: 95562、4008888123

网址: [www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(17) 华泰证券股份有限公司

住所: 南京市江东中路 228 号

办公地址: 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人: 周易

电话: 0755-82492193

联系人: 庞晓芸

客户服务电话: 95597

网址: [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(18) 华泰联合证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层 (01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址: 深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层

法定代表人: 马昭明

电话: 0755-82492000

传真: 0755-82492962

联系人: 庞晓芸

客户服务电话: 95513

网址: [www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

(19) 第一创业证券有限责任公司

住所: 广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

办公地址: 广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

法定代表人: 刘学民

电话: 0755-82485087

联系人：崔国良

客户服务电话：4008881888

网址：www.firstcapital.com.cn

（20）山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

联系人：郭熠

客户服务电话：400-666-1618、95573

网址：www.i618.com.cn

（21）金元证券股份有限公司

住所：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人：陆涛

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

客户服务电话：4008888228

网址：www.jyzq.cn

（22）华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

联系人：甘霖

客户服务电话：96518（安徽）、4008096518（全国）

网址：www.hazq.com

（23）万联证券有限责任公司

住所：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人：张建军

电话：020-37865070

传真：020-22373718-1013

联系人：罗创斌

客户服务电话：4008888133

网址：www.wlzq.com.cn

（24）中泰证券有限责任公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

联系人：吴阳

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（25）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：袁长清（代行）

联系人：刘晨

客户服务电话：10108998；4008888788

网址：www.ebscn.com

（26）广发证券股份有限公司

住所：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

电话：020-87555888

联系人：黄岚

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

网址：www.gf.com.cn

（27）湘财证券有限责任公司

住所：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：林俊波

电话：021-68634518

传真：021-68865680

联系人：钟康莺

客户服务电话：400-888-1551

网址：www.xcsc.com

（28）平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

传真：0755-82400826

联系人：郑舒丽

客户服务电话：95511-8

网址：www.pingan.com.cn

（29）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 号楼 9 层

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：余江

客户服务电话：4008001001

网址：www.essences.com.cn

（30）国联证券股份有限公司

住所：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 楼

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：徐欣

客户服务电话：4008885288，0510-82588168

网址：www.glsc.com.cn

(31) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法人代表：高冠江

电话：010-63081000

传真：010-63080978

联系人：唐静

客户服务电话：4008008899

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(32) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层

法定代表人：林义相

电话：010-66045608

传真：010-66045500

联系人：林爽

客户服务电话：010-66045678

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)、[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

(33) 华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：张腾

客户服务电话：96326

网址：[www.gfhfzq.com.cn](http://www.gfhfzq.com.cn)

(34) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场二期北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60838696

传真：010-60833739

联系人：顾凌

客户服务电话：95558

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（35）中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 21 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

联系人：吴忠超

客户服务电话：95548

网址：<http://www.zxwt.com.cn>

（36）中信证券（浙江）有限责任公司

住所：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法定代表人：沈强

电话：0571-85783737

传真：0571-85106383

联系人：李珊

客户服务电话：95548

网址：<http://www.bigsun.com.cn>

（37）长江证券股份有限公司

住所：武汉新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉新华路特 8 号长江证券大厦

法人代表：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579、4008889999

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

（38）国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系电话：0551—2272101

联系人：李蔡

客户服务电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

（39）东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22-29 楼

办公地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 22-29 楼

法定代表人：潘鑫军

电话：021-63325888

联系人：吴宇

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

（40）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096709

联系人：潘锴

客户服务电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

（41）新时代证券有限责任公司

住所：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

电话：010-83561149

传真：010-83561094

联系人：孙恺

客户服务电话：4006989898

网址：www.xsdzq.cn

（42）东海证券有限责任公司

住所：住所：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

电话：021-20333333

联系人：王一彦

客户服务电话：95531、400888588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

（43）申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人：李季

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：王君

客户服务电话：4008000562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

（44）爱建证券有限责任公司

住所：上海市南京西路758号博爱大厦20-25楼

办公地址：上海市南京西路758号博爱大厦20-25楼

法定代表人：郭林

电话：021-32229888

联系人：陈敏

客户服务电话：021-63340678

网址：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

（45）国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

联系电话：010-84183333

联系人：黄静

客户服务电话：400-818-8118

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

（46）国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路13号



办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

联系人：牛孟宇

客户服务电话：95563

网址：www.ghzq.com.cn

（47）太平洋证券股份有限公司

住所：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

办公地址：北京市西城区北展北街九号华远企业号 D 座三单元

法定代表人：李长伟

电话：010-88321818

传真：010-88321763

联系人：陈征

客户服务电话：致电各地营业网点，0871-8898130

网址：www.tpyzq.com

（48）华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：洪家新

电话：021-64316642

传真：021-54653529

联系人：陈敏

客户服务电话：4001099918（全国） 021-32109999； 029-68918888

网址：<http://www.cfsc.com.cn/>

（49）华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市东岗西路 638 号

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号

法定代表人：李晓安

电话：0931-4890619

联系人：曹占强

客户服务电话：甘肃省内：0931-96668，全国：4006898888

网址：<http://www.hlzqgs.com>

(50) 中天证券有限责任公司

住所：辽宁省沈阳市和平区光荣街 23 号甲

办公地址：沈阳市和平区南五马路 121 号 万丽城晶座 4 楼

法定代表人：马功勋

电话：024-23280842

传真：024-86268016

联系人：袁劲松

客户服务电话：4006180315

网址：[www.stockren.com](http://www.stockren.com)

(二) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：陈耀先

电话：010-58598835

传真：010-58598907

联系人：任瑞新

(三) 律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 层

负责人：廖海

经办律师：廖海、田卫红

电话：021-51150298

联系人：廖海

(四) 会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

法定代表人：葛明

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

签章会计师：严盛炜、戴维维

电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：戴维维

#### 四、基金的名称

天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

#### 五、基金的类型

契约型上市开放式

#### 六、基金的投资目标

通过将部分资产投资于品质优良、成长潜力高于平均水平的中小型上市公司股票，并将部分资产用于复制大型上市公司股票指数（富时中国 A200 指数）的业绩表现，在控制相对市场风险的前提下，追求中长期的资本增值。

#### 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的各类股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

#### 八、基金的投资策略

本基金以股票品种为主要投资标的，以“核心—卫星”策略作为股票投资的总体策略。“核心—卫星”策略是指将股票资产分为核心组合和卫星组合，核心组合通过跟踪指数进行被动投资，控制投资组合相对于市场的风险；卫星组合通过优选股票进行主动投资，追求超越市场平均水平的收益。本基金的核心组合用于跟踪大型公司股票指数（富时中国 A200 指数），卫星组合用于优选中小型成长公司股票。本基金的投资策略包括以下几个层面：

##### 1、股票投资策略

###### （1）“核心—卫星”策略

本基金通过“核心—卫星”策略将被动投资策略和主动投资策略有效结合起来，融合被动投资（核心组合）长期收益稳定、低风险、低成本和主动投资（卫星组合）具有获取超额收益机会的优势。核心组合对大型公司股票指数——富时中国 A200 指数进行优化复制，通过低成本的指数化投资，分享中国经济增长下大型公司的长期稳定收益，降低股票资产的整体风险；卫星组合将积极选股对象限定为中小型成长股，以获取优质高成长公司所带来的超额收益。

在一般情况下，本基金的资产类别配置的范围为：股票投资比例为基金净资产的 60%—95%，其中，核心组合的投资比例为股票资产净值的 55%—65%，卫星组合的投资比例为股票资产净值的 35%—45%；债券投资比例为基金净资产的 0%—

40%，现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具不低于基金净资产的 5%。

### （2）核心组合投资策略：指数投资

本基金的核心组合选择富时中国 A200 指数作为跟踪标的，进行指数化投资，以期获取该指数所代表的市场组合的平均收益。富时中国 A200 指数前身为 2001 年 7 月 26 日开始由新华富时指数公司发布的‘新华富时中国 A200 指数’，于 2010 年 12 月更名为‘富时中国 A200 指数’。该指数包含深沪两个市场中经过自由流通量和流动性检测合格的、总市值排名前 200 家的大型上市公司，涵盖 36 个行业。

在剔除基本面恶化、投资价值降低的成份股的基础上，本基金采用有约束条件的最小跟踪误差优化算法进行指数跟踪。在投资的全过程中，本基金对核心组合与富时中国 A200 指数的偏离风险进行实时跟踪和评估，力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内。

### （3）卫星组合投资策略：中小型成长股优选策略

本基金的卫星组合采用主动性投资策略，通过建立公司成长性评估系统，在深入研究的基础上发现并投资于具有良好成长性的中小型公司股票，以捕获超越市场平均水平的获利机会。

本基金中小型成长股组合构建流程如下：

图 1 中小型成长股组合构建流程

#### ①中小型公司选择

对于中国 A 股市场中的所有上市公司，按其总市值升序排列，并计算各公司所对应的累计总市值占全部公司累计总市值的百分比，将所对应的累计总市值百分比处在 $[0\%, 40\%]$ 的公司定义为中小型公司。本基金选择上述定义的中小型公司股票，建立一级股票备选库。

由于新股发行等因素导致 A 股市场市值规模分布发生较大变动时，本基金可对上述定义的中小型公司规模进行重新界定。

#### ②财务健康状况评价

在剔除法律法规和公司制度明确禁止投资的股票，包括涉及关联方交易的公司、ST 公司、\*ST 公司、出现法律问题或财务问题以及存在股价操纵嫌疑等公司的基

基础上，主要通过考察上市公司利润结构、持续性利润水平等，剔除盈利质量和经营现金质量较差的上市公司，选出财务健康的上市公司，建立二级股票备选库。

### ③成长性评估

在财务健康状况评价的基础上，运用上市公司成长性评估系统，通过对上市公司进行深入分析和实地调研，筛选具有良好持续成长性的股票，建立三级股票备选库。

上市公司成长性评估以宏观分析和行业分析作为评估的基础，对公司内部因素进行深刻理解和分析，预测其未来的成长性，从而优选出品质优良、成长潜力高于平均的上市公司。上市公司成长性评估包括宏观环境分析、行业前景分析、公司显在因素分析和公司潜在因素分析四个组成部分。

宏观环境分析：通过分析经济周期所处阶段、宏观政策以及产业政策等因素，判断公司主业是否具有广阔的潜在成长空间。

行业前景分析：通过分析公司所处行业的生命周期和是否具有稳定增长的市场需求，对公司未来成长的关键驱动因素进行考察。

公司显在因素分析：在考察上市公司历史成长性的基础上预测其未来成长性。主要运用主营业务收入增长率、扣除非经常损益后的净利润增长率、主营业务利润率、净资产收益率、每股自由现金流量等指标，通过交叉分析，对上市公司的历史成长性进行综合考察。其中，主营业务利润率和扣除非经常损益后的净利润增长率均为70%置信度下过去3年（包括年度与半年度）的增长率，即扣除了增长率中风险因素之后、在下期有70%把握达到的可信增长率。在历史成长性基础上，预测公司未来两年的每股主营业务收入增长率（SG）等指标，通过与行业平均水平和市场平均水平的比较来判断公司未来成长性，并根据预期的股价每股主营业务收入比（P/S）等指标确定最佳投资时机。

公司潜在因素分析：主要通过分析公司主导产品的市场占有率、成本控制力、技术领先性，管理团队的历史业绩、决策力、开拓性、稳定性以及公司的研发能力、营销网络等定性因素，判断公司是否具有将未来成长性转化为现实成长性的潜质。

图2 天治上市公司成长性评估体系

## 2、债券投资策略

本基金为了在一定程度上规避股票市场的系统性风险和满足基金资产的流动性要求，将小部分基金资产投资于国债、金融债、企业债、可转债、央行票据等债券品种。债券投资在综合考虑宏观经济因素和债券品种特征因素的基础上，运用利率预期、久期管理、收益率利差分析、套利交易等策略进行债券久期配置、类属配置，获取债券市场的长期稳定收益。

#### 九、基金的业绩比较基准

富时中国 A 全指×75%+富时中国国债指数×25%。

#### 十、基金的风险收益特征

本基金为具有中等风险、中高收益的混合型基金，风险收益特征介于大盘平衡型基金和小盘成长型基金之间。

#### 十一、基金的投资组合报告

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基金合同规定，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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 6 月 30 日。所列财务数据未经审计。

##### 1、 期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 639,768,597.94 89.67

其中：股票 639,768,597.94 89.67

2 固定收益投资

其中：债券

资产支持证券 --

3 金融衍生品投资 --

4 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

5 银行存款和 清算 备付金合计 57,525,479.69 8.06

6 其他资产 16,198,901.94 2.27

7 合计 713,492,979.57 100.00

## 2、 期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业

B 采矿业 51,968,440.18 7.52

C 制造业 191,892,090.92 27.77

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业

E 建筑业 400,827.20 0.06

F 批发和零售业 34,441,950.80 4.98

G 交通运输、仓储和邮政业 --

H 住宿和餐饮业

I 信息传输、软件和信息技术服务业 24,472,062.40 3.54

J 金融业 311,376,285.38 45.07

K 房地产业

L 租赁和商务服务业

M 科学研究和技术服务业 10,638,639.30 1.54

N 水利、环境和公共设施管理业

O 居民服务、修理和其他服务业

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 --

R 文化、体育和娱乐业

S 综合 14,578,301.76 2.11

合计 639,768,597.94 92.60

## 3、 基金投资前十名股票明细

序号 股票代码 股票名称 数量（股） 公允价值(元) 占基金资产净值比例（%）

1 603993 洛阳钼业 10,000,000 41,500,000.00 6.01

2 600576 万家文化 1,579,906 34,441,950.80 4.98

3 000776 广发证券 1,787,600 29,960,176.00 4.34

4 601198 东兴证券 1,175,000 28,717,000.00 4.16

5 002500 山西证券 1,599,994 26,495,900.64 3.83

6 002673 西部证券 850,000 21,981,000.00 3.18

7	601689 拓普集团	650,000	21,417,500.00	3.10
8	601555 东吴证券	1,550,000	20,770,000.00	3.01
9	002444 巨星科技	1,020,000	20,726,400.00	3.00
10	601788 光大证券	1,219,986	20,666,562.84	2.99

4、 期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、 基金投资前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、 期末基金投资前五名权证证明细

本基金本报告期末未持有权证。。

7、 期末基金投资前十名资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8、 投资组合报告附注

(1) 本基金投资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。

(2) 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产的构成

序号 名称 金额（元）

1	存出保证金	1,881,698.06
2	应收证券清算款	14,208,394.03
3	应收股利	-
4	应收利息	35,263.55
5	应收申购款	73,546.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,198,901.94

(4) 期末本基金持有处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。



(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率比较表：

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)

2006年1月20日-

2006年12月31日 75.78% 1.32% 75.76% 1.07% 0.02% 0.25%

2007年1月1日-

2007年12月31日 126.33% 2.03% 120.24% 1.73% 6.09% 0.30%

2008年1月1日-

2008年12月31日 -57.31% 2.13% -45.74% 2.30% -11.57% -0.17%

2009年1月1日-

2009年12月31日 50.60% 1.61% 76.26% 1.53% -25.66% 0.08%

2010年1月1日-

2010年12月31日 1.28% 1.48% -3.04% 1.17% 4.32% 0.31%

2011年1月1日-

2011年12月31日 -25.18% 1.23% -19.96% 1.01% -5.22% 0.22%

2012年1月1日-

2012年12月31日 11.73% 1.08% 4.55% 1.01% 7.18% 0.07%

2013年1月1日-2013年12月31日 16.38% 1.31% 0.20% 1.01% 16.18% 0.30%

2014年1月1日-2014年12月31日 17.82% 1.26% 33.25% 0.85% -15.43%

0.41%

2015年1月1日-2015年12月31日 32.79%

2.66%

20.4300%

1.89%

112.36%

0.7700%

2016年1月1日-2016年6月30日 -36.11% 2.66% -13.29% 1.62% -22.82%

1.04%

### 十三、费用概览

#### 1、与基金运作有关的费用

##### (1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### (2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按基金资产净值的2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(3) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

##### (4) 证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金合同生效后的

会计师费和律师费、基金份额持有人大会费用、基金上市的费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等根据有关法规及相关合同的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

(5) 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

## 2、与基金销售有关的费用

### (1) 认购费

本基金的认购包括场内认购和场外认购两种方式。本基金场外认购费率如下：

认购金额 M (含认购费) 认购费率

$M < 25$  万元 1.0%

$25 \text{ 万元} \leq M < 100$  万元 0.6%

$100 \text{ 万元} \leq M < 500$  万元 0.3%

$M \geq 500$  万元 每笔 1000 元

投资人场内认购的券商佣金比率由深圳证券交易所会员单位按照本基金招募说明书中约定的场外认购的认购费率设定。

认购费将用于支付发售期间审计费、律师费、注册登记费、销售费及市场推广等费用。募集期间发生的各项费用不从基金财产中列支。

### (2) 申购费

本基金的申购包括场内申购和场外申购两种方式。申购费率不高于 1.5%，随申购金额的增加而递减，具体费率如下表所示：

申购金额 (M, 含申购费) 申购费率

$M < 25$  万元 1.5%

$25 \text{ 万元} \leq M < 100$  万元 1.0%

$100 \text{ 万元} \leq M < 500$  万元 0.5%

$M \geq 500$  万元 每笔收取 1200 元

申购费由申购人承担，可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

### (3) 赎回费

本基金的赎回包括场内赎回和场外赎回两种方式。场内赎回费率统一为 0.5%，场外赎回费率根据投资人持有本基金时间的增加而递减，具体费率如下表所示：

持有期限(N) 赎回费率

$N < 1$  年 0.5%

$1 \text{ 年} \leq N < 2$  年 0.3%

$N \geq 2$  年 0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费用的 75%用于注册登记费及相关手续费等，25%归入基金财产。

#### (4) 申购赎回费率的调整

基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费用和赎回费用标准，调整后的申购费用和赎回费用标准在最新的招募说明书中列示。上述费用标准如发生变更，基金管理人最迟应于新的费用标准实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金 2016 年 3 月 4 日公布的《天治核心成长股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“基金管理人”中，对董事、监事、经理层成员，本基金基金经理信息进行了更新。
- 2、在“基金托管人”中，对基金托管人基本情况、基金托管业务经营情况等信息进行了更新。
- 3、在“相关服务机构”中，更新了代销机构的相关信息。
- 4、在“基金合同的生效”中，更新了基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模限制的相关内容。
- 5、在“基金的投资”中，更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
- 6、在“基金的业绩”中，更新了基金合同生效以来的投资业绩。
- 7、在“对基金份额持有人的服务”中，增加了持有人注册与过户登记服务，更新了资料寄送服务的内容。
- 8、在“其他应披露事项”中，列出了自 2016 年 1 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日期间与本基金和本基金管理人有关的公告。

天治基金管理有限公司

2016年9月2日