

# 天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

## 更新的招募说明书（摘要）

（2018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：中国民生银行股份有限公司

### 重要提示

本基金由天治品质优选混合型证券投资基金转型而来，经中国证券监督管理委员会2015年12月10日证监许可【2015】2898号文变更注册，并依据2016年4月18日天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，天治品质优选混合型证券投资基金调整投资目标、投资范围、投资策略、基金费用、收益分配方式、估值方法以及修订基金合同等，并更名为“天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金”。自2016年4月18日起，《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

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中国民生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2018年10月17日，有关财务数据截止日为2018年9月30日，净值表现截止日为2018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：吕文龙
- 5、办公地址：上海市复兴西路159号
- 6、电话：021-60371155
- 7、联系人：赵正中
- 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) 基金管理人主要人员情况

#### 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。

徐克磊先生：董事，硕士学历，曾任泰达宏利基金管理有限公司(原湘财合丰基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司)IT部总经理、综合管理部总经理、营销策划部总经理、公司总经理助理兼业务副总监、总经理助理兼新闻发言人，现任天治基金管理有限公司总经理。

张纪军先生：董事，硕士学历，曾任吉林省信托投资有限责任公司自营部业务员、研发部经理、深圳子公司总经理，吉林省亚东投资管理有限责任公司深圳子公司董事长、总公司总经理助理、副总经理，现任吉林森工集团有限责任公司副总经理、吉林森工集团财务有限责任公司董事长。

李巍先生：董事，中共党员，工程师职称。1996年起加入吉林省信托有限责任公司，历任项目经理、信托业务部副总经理、北京信托一部总经理，现任吉林省信托有限责任公司市场总监兼北京信托一部总经理。

武雷先生：独立董事，学士，曾任北京市政府对外服务办公室公务员、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、上海市申达律师事务所法定代表人及首席合伙人。现任观涛中茂律师事务所上海办公室主任。

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、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）。

牛葵女士：监事，本科学历，高级经济师，曾在吉林省信托有限公司星火项目部、证券部、计划财务部、投行部、信托资产管理部工作，现任吉林省信托有限责任公司监察审计部副总经理（主持工作）。

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。

赵正中先生：职工监事，本科学历，1998年起就职于中国纺织大学，2000年起就职于广发证券股份有限公司，2003年加入天治基金管理有限公司，曾任信息技术部副总监，现任公司监察稽核部总监。

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。

## 2、现任基金经理

曾海先生：硕士研究生，具有基金从业资格，证券从业经验10年。2001年7月至2005年8月就职于上海丝绸（集团）股份有限公司，2005年9月至2006年8月就职于皮尔磁工业自动化贸易（上海）有限公司，2008年7月至2009年2月就职于交银国际控股有限公司

任研究员，2009年3月至2011年2月就职于国联证券股份有限公司任研究员，2011年3月至2013年6月就职于光大保德信基金管理有限公司任研究员，2013年9月至今就职于天治基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理。2015年6月12日起任本基金的基金经理。

本基金历任基金经理：2005年1月12日至2007年4月12日，刘红兵先生任基金经理；2005年3月11日至2005年8月28日，袁柏南先生与刘红兵先生共同管理本基金；2005年8月29日至2010年5月28日谢京先生任基金经理；2011年10月21日起至2014年1月29日吴战峰先生任基金经理。2010年5月28日至2015年6月12日秦海燕女士任基金经理。2014年1月29日至2015年6月12日陈勇先生任基金经理。

### 3、投资决策委员会成员

天治基金管理有限公司总经理兼投资总监徐克磊先生，投资副总监兼权益投资部总监许家涵先生，研究发展部总监尹维国先生，投资副总监兼固定收益部总监王洋女士。

### 4、上述人员之间无亲属关系。

## 二、基金托管人

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

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

成立时间：1996年2月7日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

## 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

住所：上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室

法定代表人：吕文龙

办公地址：上海市复兴西路 159 号

电话：021-60374900

传真：021-60374934

联系人：洪韦芸

客户服务电话：400-098-4800（免长途通话费用）、021-60374800

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/etrading>

## 2、其他销售机构

### （1）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)

### （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

法定代表人：田国立

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) 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)

(4) 兴业银行股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 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：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

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) 上海银行股份有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 168 号

办公地址：上海市银城中路 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)

(8) 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>

(9) 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：周慕冰

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)

(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：陈共炎

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，朱雅崑

客户服务电话：955521

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](http://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：4008888108

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：官少林

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

(16) 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

(17) 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

（18）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：上海市浦东新区长柳路36号

法定代表人：杨华辉

电话：0591-38507679

联系人：乔琳雪

客户服务电话：95562、4008888123

网址：www.xyzq.com.cn

（19）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

（20）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：王作义

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

（21）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

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579、4008888999

网址：www.95579.com

（22）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

（23）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

(24) 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

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

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：95573、4006661618

网址：www.i618.com.cn

(25) 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

(26) 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

(27) 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

（28）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

（29）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：薛峰

联系人：何耀

客户服务电话：10108998 ； 4008888788

网址：www.ebscn.com

（30）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

(31) 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

办公地址：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

(32) 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：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号平安金融大厦 26 楼

法定代表人：曹实凡

传真：0755-82400826

联系人：石静武

客户服务电话：95511-8

网址：www.pingan.com.cn

(33) 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

(34) 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：4008-000-562

网址：www.hysec.com

(35) 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

(36) 东海证券有限责任公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

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、4008888588

网址：www.longone.com.cn

(37) 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

(38) 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

(39) 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

法定代表人：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

(40) 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：<http://www.txsec.com>、<http://jjm.com.cn>



(41) 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)

(42) 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)

(43) 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>

(44) 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>

(45) 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](http://www.ghzq.com.cn)

(46) 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](http://www.tpyzq.com)

(47) 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 楼中天证券

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)

(48) 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>

(49) 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/>

(50) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

联系人：罗艺琳

客户服务电话：95329

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

(51) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

电话：021-20835789

传真：021-20835885

联系人：周轶

客户服务电话：400-920-0022

网址：<http://licaike.hexun.com/>

(52) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

法定代表人：汪静波

电话：021-38602377

传真：021-38509777

联系人：方成

客户服务电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(53) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

电话：021-54509988

传真：021-64385308

联系人：潘世友

客户服务电话：4001818188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(54) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

电话：021-58870011

传真：021-68596916

联系人：张茹

客户服务电话：4007009665

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

(55) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691832

传真：021-20691861

联系人：单丙烨

客户服务电话：400-089-1289

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

(56) 深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 Halo 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

联系人：童彩平

客户服务电话：4006-788-887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)、[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(57) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：祖国明

电话：021-60897869

传真：0571-26698533

联系人：张裕

客户服务电话：4000 766 123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(58) 北京万银财富投资有限公司

住所：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内

法定代表人：李招弟

电话：010-59393923

传真：010-59393074

联系人：毛怀营

客户服务电话：400-059-8888

网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

(59) 北京钱景财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

电话：010-57418829

传真：010-57569671

联系人：魏争

客户服务电话：400-678-5095

网址：[www.niuji.net](http://www.niuji.net)

(60) 北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

电话：010-62020088

传真：010-62020355

联系人：宋丽冉

客户服务电话：400-888-6661

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

(61) 深圳腾元基金销售有限公司

住所：广东省深圳市福田区金田路卓越世纪中心一号楼 1806-1808 单元

办公地址：广东省深圳市福田区金田路卓越世纪中心一号楼 1806-1808 单元

法定代表人：曾革

电话：0755-33376853

传真：0755-33065516

联系人：鄢萌莎

客户服务电话：4006-877-899

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

(62) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人：沈伟桦

电话：010-52855713

传真：010-85894285

联系人：程刚

客户服务电话：400-6099-200

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

(63) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

联系人：吴强

客户服务电话：4008-773-772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(64) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

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

(65) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 层

法定代表人：袁顾明

联系人：朱真卿

电 话：021-20324159

传 真：021-20324199

客服电话：400-928-2266

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

(66) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

办公地址：杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：徐黎云

联系人：孙成岩

电 话：0571-88337717

传 真：0571-88337666

客服电话：400-068-0058

网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

(67) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电 话：021-52822063

传 真：021-52975270

客服电话：400-166-6788



网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(68) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发  
展区）

办公地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

电 话：021-65370077

传 真：021-55085991

客服电话：400-820-5369

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

(69) 上海有鱼基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 2023 号 3 层 3E-2655 室

办公地址：上海市桂平路 391 号新漕河泾国际商务中心 A 座 5 楼

法定代表人：林琼

联系人：徐海峥

电 话：021-64389188

传 真：021-64389188-102

客服电话：4007676298

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

(70) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

联系人：张喆

电 话：010-56075718

传 真：010-67766715

网址：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

(二) 登记机构

名称：天治基金管理有限公司

办公地址：上海市复兴西路159号

法定代表人：吕文龙

电话：021-60374960

传真：021-60374974

联系人：黄宇星

### **（三）出具法律意见书的律师事务所**

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系电话：(86 21) 3135 8666

传真：(86 21) 3135 8600

联系人：安冬

经办律师：安冬、陆奇

### **（四）审计基金财产的会计师事务所**

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

法定代表人：毛鞍宁

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

经办注册会计师：蒋燕华、石静筠

联系人：蒋燕华

## **四、基金的名称**

天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

## **五、基金的类型**

契约型开放式

## 六、基金的投资目标

在灵活配置股票和债券资产的基础上，精选受益于低碳经济的主题相关企业，追求持续稳健的超额回报。

## 七、基金的投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于受益于低碳经济主题相关企业的证券不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

### 1、资产配置策略

资产配置策略方面，本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据宏观经济运行态势、政策变化、市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。

本基金实施大类资产配置策略过程中还将根据各类证券的风险收益特征的相对变

化，动态优化投资组合，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。

## 2、股票投资策略

在全球气候变暖的背景下，以低能耗、低污染为基础的“低碳经济”成为全球热点。低碳经济是一种以低能耗、低污染、低排放为特点的发展模式，是以应对气候变化、保障能源安全、促进经济社会可持续发展有机结合为目的的新规则。本基金将沿着低碳经济的路线，把握其中蕴含的投资机会。

### （1）低碳经济主题类股票的界定：

本基金认可的低碳经济主题类股票包括两种类型的股票：

#### 1) 直接从事低碳经济主题相关行业的股票

①清洁能源：主要包括清洁能源的研发、生产与运营，如风能、太阳能、生物质能、水电及核电等；也包括清洁能源的传输、服务等配套产业，如特高压输电、智能电网等相关上市公司；

②节能减排：主要包括与节能技术和装备、节能产品及节能服务产业的相关上市公司，如工业节能、建筑节能、汽车节能；也包括化石能源减排，如清洁燃煤、整体煤气化联合循环、碳捕获与封存等相关上市公司；

③碳交易与陆地碳汇、海洋碳汇：主要包括与清洁发展机制项目和农林产业减排增汇等相关的上市公司；

④环保行业：包括环保技术和设备、环保服务和资源利用等相关行业的上市公司；

#### 2) 受益于低碳经济主题的股票，包括：

①传统高耗能高污染行业中，通过有效节能减排措施或污染治理措施，实现能耗降低、污染改善，从而实现产业升级，相对同类公司受益的上市公司；

②与低碳经济主题相关的服务行业

③投资于低碳经济相关产业的上市公司；

④因与低碳经济主题相关的产业结构升级、消费生活模式转变而受益的其他上市公司。

未来，由于经济增长方式转变、产业结构升级等因素，从事或受益于上述投资主题的外延将会逐渐扩大，本基金将视实际情况调整上述对低碳环保主题类股票的识别及认定。

### （2）个股投资策略

通过行业领先度和市场领先度的双重定量评价以及长期驱动因素和事件驱动因素

的双重定性分析，精选受益于低碳经济主题相关企业进行重点投资。

行业领先度主要考察盈利能力、行业贡献度和主营业务显著度，其中以盈利能力为主。盈利能力通过净资产收益率和毛利率并辅以经营性现金净流量和自由现金流量进行综合评估，行业贡献度依据营业收入和营业利润在行业中占比进行衡量，主营业务显著度通过主营行业或产品的营业收入占比和营业利润占比进行比较。

市场领先度主要考察估值水平、流动性和机构认同度，其中以估值水平为主。估值水平通过 PE、PS、PB、净利润增长率、营业收入增长率、PEG、PSG 等静态估值水平、动态估值水平、历史成长性、预期成长性指标以及综合估值水平与成长性的指标进行横向和纵向比较，流动性指标包括自由流通比例和日均换手率、日均交易额等交易活跃度指标，机构认同度是指外部研究机构对个股的成长性与价值的一致性预期。

长期驱动因素主要考察主营业务前景、管理层能力、公司战略和治理结构。以上因素作为公司内生性成长的基础，是公司可持续性发展的保障。

事件驱动因素主要考察公司是否存在兼并收购、投资项目、资产增值等基本面的正向变动。以上因素是公司外延式增长的体现，作为长期驱动因素分析的有效补充。

### 3、债券投资策略

在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向、发行人情况和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术选择个券，选择被价格低估的债券进行投资。

本基金投资于中小企业私募债。由于中小企业私募债券整体流动性相对较差，且整体信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。

### 4、权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

### 5、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

## 6、股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值或期限套利等操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

## 九、基金的业绩比较基准

中证内地低碳经济主题指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

## 十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国民生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 2018 年 9 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	24,737,345.04	80.89
	其中：股票	24,737,345.04	80.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,033,438.70	16.46
8	其他资产	811,826.32	2.65
9	合计	30,582,610.06	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	2,254,360.84	8.05
C	制造业	6,749,984.20	24.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,115,000.00	7.55
F	批发和零售业	-	-
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	857,850.00	3.06

	务业		
J	金融业	11,783,510.00	42.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	476,140.00	1.70
M	科学研究和技术服务业	500,500.00	1.79
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	-	-
	合计	24,737,345.04	88.32

### 3、期末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	601398	工商银行	243,000	1,402,110.00	5.01
2	000001	平安银行	126,000	1,392,300.00	4.97
3	601857	中国石油	150,000	1,375,500.00	4.91
4	000858	五粮液	20,000	1,359,000.00	4.85
5	601186	中国铁建	120,000	1,338,000.00	4.78
6	600036	招商银行	40,000	1,227,600.00	4.38
7	601288	农业银行	300,000	1,167,000.00	4.17
8	601336	新华保险	20,000	1,009,600.00	3.60
9	000651	格力电器	24,971	1,003,834.20	3.58
10	000661	长春高新	4,000	948,000.00	3.38

### 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、期末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证明细

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) 根据 2018 年 5 月 4 日发布的中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银监罚决字【2018】1 号），招商银行股份有限公司（招商银行：600036.SH）存在以下主要违法违规事实：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。中国银监会于 2018 年 2 月 12 日对其作出行政处罚决定：罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

本基金投研人员分析认为，招商银行受到中国银监会的相关行政处罚对公司的主业经营影响较小。招商银行作为最优秀的银行之一，资产质量较高，具有较强的可持续发展动力。本基金基金经理根据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对招商银行进行了投资。

根据 2018 年 10 月 18 日发布的中国保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚罚决字【2018】1 号），新华保险（证券代码：601336.SH）存在以下主要违法行为：（一）欺骗投保人；（二）编制提供虚假资料；（三）未按照规定使用经批准或者备案的保险费率。中国银保监会于 2018 年 9 月 29 日决定对其作出如下处罚：（一）新华保险欺骗投保人的行为违反《保险法》第一百一十六条，根据该法第一百六十一条，决定对新华保险罚款 30 万元；根据该法第一百七十一条，决定对李源警告并罚款 8 万元，对于志刚警告并罚款 10 万元，对罗晓晖警告并罚款 10 万元，对秦奋警告并罚款 10 万元；（二）新华保险编制提供虚假资料的行为违反《保险法》第八十六条，根据该法第一百七十条，决定对新华保险罚款 50 万元；根据该法第一百七十一条，决定对李源警告并罚款 10 万元，对于志刚警告并罚款 10 万元，对王练文警告并罚款 5 万元，对安秀丽警告并罚款 10 万元，对唐鹤飞警告并

罚款 10 万元，对刘晓芳警告并罚款 10 万元，对秦奋警告并罚款 5 万元，对朱敏警告并罚款 5 万元，对王洪礼警告并罚款 2 万元；（三）新华保险未按照规定使用经批准或者备案的保险费率的行为违反《保险法》第一百三十五条，根据该法第一百七十条，决定对新华保险罚款 30 万元；根据该法第一百七十一条，决定对李源警告并罚款 6 万元，对罗晓晖警告并罚款 6 万元。

根据 2018 年 2 月 24 日发布的中国保监会监管函【2018】31 号，新华保险因其境外投资业务违反了《保险资金境外投资管理暂行办法实施细则》关于可投资国家或者地区的相关规定，中国保监会于 2018 年 2 月 11 日向其发出监管函。

本基金投研人员分析认为，新华保险受到中国银保监会的相关行政处罚对公司的主要经营影响较小。公司作为国内主要的保险公司之一，资产质量较高，具有较强的可持续发展动力。本基金基金经理根据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对新华保险进行了投资。

根据六安监管罚【2018】大队-26 号，中国石油（证券代码：601857.SH）违反《中华人民共和国职业病防治法》第七十一条第一项，六合区安全生产监督管理局于 2018 年 5 月 23 日对其作出处罚决定：罚款人民币 5 万元。

本基金投研人员分析认为，中国石油受到六合区安全生产监督管理局的相关行政处罚对公司的主要经营影响较小。公司作为国有三大石油公司之一，资产质量较高，具有较强的可持续发展动力。本基金基金经理根据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对中国石油进行了投资。

本基金投资的前十名证券中其他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）期末其他资产的构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	77,635.74
2	应收证券清算款	723,405.51
3	应收股利	-
4	应收利息	1,076.94
5	应收申购款	9,708.13
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	811,826.32

(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不存在流通受限情况。

(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)
2016年4月18日(基金合同生效日) — 2016年12月31日	-14.87%	1.29%	0.11%	0.49%	-14.98%	0.80%
2017年1月1日 - 2017年12月31日	29.15%	0.84%	9.55%	0.47%	19.60%	0.37%
2018年1月1日 - 2018年6月30日	-19.59%	1.31%	-8.93%	0.64%	-10.66%	0.67%

## 十三、费用概览

### 1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

- (4) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金的证券、期货交易费用；
- (7) 基金的银行汇划费用；
- (8) 基金的账户开户费用、账户维护费用；
- (9) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### (1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 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

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 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。

上述“1、基金费用的种类中第（3）—（9）项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- (1) 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的费用支出或基金

财产的损失；

- (2) 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- (3) 《基金合同》生效前的相关费用；
- (4) 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 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2018年6月1日公布的《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“基金管理人”中，对“基金管理人主要人员情况”进行了更新。
- 2、在“基金托管人”中，对“基金托管人情况”和“基金托管人的内部控制制度”进行了更新。
- 3、在“相关服务机构”中，对“其他销售机构”的相关信息进行了更新。
- 4、在“基金的投资”中，更新了“基金投资组合报告”的内容。
- 5、在“基金的业绩”中，更新了基金合同生效以来的投资业绩。
- 6、在“基金托管协议的内容摘要”中，更新了“托管协议当事人”的相关内容。
- 7、在“对基金份额持有人的服务”中，更新了“资料寄送服务”的相关内容。
- 8、在“其他应披露事项”中，列出了自2018年4月18日至2018年10月17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

2018年12月1日