

# 天治稳健双盈债券型证券投资基金

## 更新的招募说明书（摘要）

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

二〇二〇年六月

### 重要提示

本基金经中国证监会《关于核准天治稳健双盈债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2008】817号文）准予募集。2020年1月13日，本基金基金份额持有人大会以【通讯】方式召开，大会审议通过了《关于修改天治稳健双盈债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，内容包括调整本基金投资范围、投资策略、投资限制、收益分配原则等事项。自2020年1月13日起，根据《关于修改天治稳健双盈债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》修订而成的《天治稳健双盈债券型证券投资基金基金合同》生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。招募说明书经中国证监会变更注册，但中国证监会对本基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金属于主动管理的债券型基金，为证券投资基金中的较低风险较低收益品种，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、管理风险、流动性风险、技术风险、其他风险、本基金的特定风险等。

本基金可投资资产支持证券，主要存在以下风险：1) 特定原始权益人破产风险、现金流预测风险等与基础资产相关的风险；2) 资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、评级风险等与资产支持证券相关的风险；3) 管理人违约违

规风险、托管人违约违规风险、专项计划账户管理风险、资产服务机构违规风险等与专项计划管理相关的风险；4) 政策风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险等其他风险。

本基金投资国债期货，国债期货交易采用保证金交易方式，基金资产可能由于无法及时筹措资金满足建立或者维持国债期货头寸所要求的保证金而面临保证金风险。同时，该潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。另外，国债期货在对冲市场风险的使用过程中，基金资产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临基差风险。

投资有风险，投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，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。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者的风险承受能力相适应。

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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩亦不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。

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。

投资者应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构认/申购和赎回基金，基金销售机构名单详见本招募说明书以及相关公告。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为2020年4月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日。

招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：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

办公地址：上海市复兴西路159号

法定代表人：单宇

成立日期：2003年5月27日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]73号

组织形式：其他有限责任公司

注册资本：1.6亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：021-60371155

联系人：赵正中

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

单宇先生：董事长，硕士学历，曾任吉林省信托有限责任公司证券投资部经理，吉林省宝路达投资管理有限公司总经理、天治基金管理有限公司筹备组成员，天治基金管理有限公司副总经理、监事长，东北证券副总裁、副总裁兼合规总监，东方基金管理有限公司董事、总经理，东北证券党委副书记，东证融通投资管理有限公司董事长、副董事长，现任天治基金管理有限公司董事长。

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。

王万军先生：独立董事，硕士研究生学历，曾任职于吉林省经济体制改革委员会股份制工作处，中国证监会吉林证监局，历任吉林证监局上市发行处副处长、机构监管处处长、上市公司监管处处长，现任恒泰长财证券有限责任公司合规总监，并获聘担任深圳证券交易所理事会行政复议委员会委员。

周鹏女士：独立董事，法学硕士，曾先后于中国环球律师事务所、金杜律师事务所、盛德国际律师事务所、北京宽信律师事务所担任律师和资深律师，2012年担任中国华安投资有限公司法律顾问，2016年担任中国信达（香港）控股有限公司风险总监兼法律顾问，现为上海耀良律师事务所合伙人，为英国特许会计师公会准会员。

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、工会主席，现任天治基金管理有限公司监事会主席（职工监事）、公司党支部委员、公司工会主席。

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）。

米巍先生：监事，本科学历，中共党员。2008年起加入中国吉林森林工业集团有限责任公司，先后在吉林新合木业、金桥地板集团及吉林森工集团总部工作，现任中国吉林森林工业集团有限责任公司资本运营部副部长。

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。

张健先生，职工监事，硕士研究生。2003年起加入天治基金管理有限公司，先后担任综合管理部行政主管、副总监、总监，现任综合管理部总监、公司工会委员。

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，硕士研究生，中共党员，高级经济师职称。1996年至2009年在吉林省信托有限责任公司任职，先后担任团总支书记、自营业务部副经理、经理、证券部经理、市场研发部经理，2009年6月起加入天治基金管理有限公司，曾任公司财务总监、总经理助理、副总经理，现任天治基金管理有限公司副总经理、首席信息官。

## 2、基金经理

王洋女士：硕士研究生，具有基金从业资格，证券从业经验12年，2007年9月至今就职于天治基金管理有限公司，曾任交易员、研究员、基金经理助理，2013年12月10日至2015年3月16日任天治天得利货币市场基金的基金经理，2015年2月17日至2018年8月7日任天治研究驱动混合型证券投资基金的基金经理，2016年12月7日至2018年7月27日任天治鑫利纯债债券型证券投资基金的基金经理。现任公司投资副总监兼固定收益部总监，2014年9月4日起任天治可转债增强债券型证券投资基金的基金经理、2015年2月17日起任本基金的基金经理、2019年11月20日起任天治稳健双盈债券型证券投资基金的基金经理。

本基金历任基金经理：2008年11月5日（基金合同生效日）至2010年5月18日，贺云先生任基金经理；2010年4月14日至2015年2月17日，秦娟女士任基金经理。

## 3、投资决策委员会成员

天治基金管理有限公司总经理徐克磊先生，投资总监兼权益投资部总监许家涵先生，研究总监兼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，量化投资部总监TIAN HUAN先生。

## 4、上述人员之间无亲属关系。

## 二、基金托管人

### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称“中国农业银行”）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：34,998,303.4万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额销售机构

##### 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

办公地址：上海市复兴西路159号

法定代表人：单宇

电话：021-60374900

传真：021-60374934

联系人：洪韦芸、韩涵

客服电话：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/etrading.jsp>

##### 2、其他销售机构

###### （1）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：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

传真：010-85109219

联系人：贺倩

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(2) 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：010-66107900

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(3) 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

(4) 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：任德奇

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：王菁

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(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：郑杨  
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

(6) 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

(7) 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：李庆萍  
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

(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 号北京银行大厦  
法定代表人：张东宁



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) 浙商银行股份有限公司

住所：浙江杭州市庆春路 288 号

办公地址：浙江杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

电话：0571-87659546

传真：87569188

联系人：唐燕

客户服务电话：95527

网址：<http://www.czbank.com/czbank/>

(10) 吉林银行股份有限公司

注册地址：吉林省长春市东南湖大路 1817 号

办公地址：吉林省长春市东南湖大路 1817 号

法定代表人：张宝祥

联系人：孟明

电话：0431-84992680

传真：0431-84992649

客服电话：4008896666

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

(11) 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：辛国政

客户服务电话：4008888888、95551

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

(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：周杰

电话：021-23219000

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553

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

(13) 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：杨玉成

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](http://www.swhysc.com)

(14) 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：010-85156398

联系人：许梦园

客户服务电话：4008888108、95587

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(15) 广发证券股份有限公司

住所：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

电话：020-66338888

联系人：马梦洁

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

(16) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路 11 号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 11 号

法定代表人：霍达

电话：0755-82943666

传真：0755-83734343

联系人：黄婵君

客户服务电话：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

(17) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：周健男

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：何耀

客户服务电话：95525

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

(19) 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：章宏韬

电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

联系人：范超

客户服务电话：95318

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

(20) 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：李新华

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：奚博宇

客户服务电话：95579、4008888999

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

(21) 中泰证券有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

电话：021-20315290

传真：0531-68889752

联系人：秦雨晴

客户服务电话：95538

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

(22) 平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25

法定代表人：何之江

传真：0755-82400826

联系人：周驰

客户服务电话：95511-8

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

(23) 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：孙永祥

电话：021-38784580-8920

传真：021-68865680

联系人：江恩前客户服务电话：95351

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

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

法定代表人：王连志

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

客户服务电话：4008001001

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

(25) 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：刘萍

客户服务电话：95372

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

(26) 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：广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层

法定代表人：罗钦城

电话：020-38286026

传真：020-38286862

联系人：甘蕾

客户服务电话：95322

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

(27) 国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座

法定代表人：俞仕新

电话：0551-2272101

联系人：李蔡

客户服务电话：95578

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

(28) 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 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](http://www.dfzq.com.cn)

(29) 第一创业证券有限责任公司

住所：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

电话：0755-23838751

传真：0755-23838999-8751

联系人：吴军

客户服务电话：95358

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

(30) 东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096517

联系人：安岩岩

客户服务电话：95360

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(31) 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：0351-8686667

联系人：郭熠

客户服务电话：400-666-1618、95573

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(32) 爱建证券有限责任公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：祝健

电话：021-32229888

联系人：陈敏

客户服务电话：4001962502

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

(33) 东海证券有限责任公司

注册地址：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：钱俊文

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

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

(34) 新时代证券有限责任公司

注册地址：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：叶顺德

电话：010-83561000

传真：010-83561001

联系人：田芳芳

客户服务电话：95399

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

(35) 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：无锡市金融一街 8 号

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：祁昊

客户服务电话：95570

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

(36) 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：肖林

电话：010-63080100

传真：010-63080144

联系人：唐静

客户服务电话：95321

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

(37) 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)

(38) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

联系电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：钟伟镇

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

服务热线：95521 / 4008888666

(39) 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：张伟

电话：021-50531281

传真：021-83387254

联系人：庞晓芸

客户服务电话：95597

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

(40) 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：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18 楼

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：刘晨

客户服务电话：96326（福建省外先拨 0591）

网址：<http://www.hfzq.com.cn/>

(41) 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：张佑君

电话：010-60838696

传真：010-60833739

联系人：杜杰

客户服务电话：95548

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

(42) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

基金业务联系人：焦刚

电话：0531-89606166

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

公司网址：[sd.citics.com](http://sd.citics.com)

(43) 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 号国海大厦

法定代表人：何春梅

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)

(44) 华龙证券有限责任公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

组织形式：股份有限公司

法定代表人：陈牧原

电话：0931-4890208

传真：0931-4890628

基金业务联系人：范坤

客户服务电话：95368

公司网址：[www.hlzq.com](http://www.hlzq.com)

(45) 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：郑亚南

电话：010-88321875

传真：010-88321763

联系人：王婧

客户服务电话：95397

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

(46) 中天证券有限责任公司

注册地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

办公地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

法定代表人：马功勋

基金业务联系人：孙丹华

电话：024-2328 0839

传真：024-2284 2073

客户服务电话：95346

公司网址：[www.iztzq.com](http://www.iztzq.com)

(47) 西部证券股份有限公司

住所：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

办公地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

法定代表人：刘建武

电话：029-87406649

传真：029-87406710

联系人：刘莹

客户服务电话：95582

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

(48) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋  
20C-1 房

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

电话：021-64339000

传真：021-54967293

联系人：杨莉娟

业务联系电话：021-54967552

客户服务电话：95323, 4001099918 (全国) ; 029-68918888

客服电话：95323、4001099918

华鑫证券公司网站：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

(49) 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发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 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)

(50) 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：021-36696312

传真：021-68596916

联系人：高源

客户服务电话：4007009665

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

(51) 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：上海市徐汇区宛平南路 88 号 26 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)

(52) 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：021-2069-1935

传真：021-20691861

联系人：党敏

客户服务电话：400-089-1289

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

(53) 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：邱佳捷

客户服务电话：400-821-5399

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

(54) 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：010-85657353

传真：021-20835885

联系人：陈慧

客户服务电话：400-920-0022

网址：<http://licaike.hexun.com/>

(55) 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：0571-26888888

传真：0571-26698533

联系人：何倩

客户服务电话：4000 766 123

网址：www.fund123.cn

（56）浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园4区13号楼A座9层908室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08

法定代表人：聂婉君

联系人：李艳

电话：010-59497361

传真：010-64788016

客服电话：400-012-5899

公司网站：www.zscffund.com

（57）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：010-59158135

传真：010-57569671

联系人：曹金宝

客户服务电话：400-678-5095

网址：www.niuji.net

（58）北京展恒基金销售有限公司

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：010-59601366

传真：010-62020355

联系人：吴志花

客户服务电话：400-888-6661

网址：www.myfund.com

（59）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

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：010-52413385

传真：010-85894285

联系人：魏晨

客户服务电话：400-6099-200

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

(60) 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：龚江江

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)

(61) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路甲 40 号二十一世纪大厦 A303

法定代表人：王岩

电话：010-59200855

传真：010-59200800

联系人：胡明会

客户服务电话：400-819-9868

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

(62) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：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



联系人：李珍珍

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客服电话：95105885

网址：<http://www.10jqka.com.cn/>

(63) 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：程晨

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

网址：<http://www.lufunds.com/>

(64) 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：张永辉

电话：021-58373275

传真：021-20324199

客服电话：400-928-2266

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

(65) 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：居晓菲

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)

(66)上海联泰基金销售有限公司

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：400-118-1188

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

(67)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)

(68)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)

(69)上海钜派钰茂基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区泥城镇新城路2号24幢N3187室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路379号14楼C座

法定代表人：杨雅琴

电话：021-68670358

联系人：洪思夷

客户服务电话：4006-889-967

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

(70) 济安财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

法定代表人：杨健

电话：010-65309516

传真：010-65330699

联系人：李海燕

客户服务电话：4006-737-010

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

(71) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场18层

法定代表人：李兴春

电话：18918352892

传真：021-61101630

联系人：徐亮

客户服务电话：95733

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

## (二) 登记机构

名称：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

办公地址：上海市复兴西路159号

法定代表人：单宇  
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  
电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
经办律师：安冬、丁媛  
联系人：安冬

### （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 17 层 01-12 室  
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  
执行事务合伙人：毛鞍宁  
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

天治稳健双盈债券型证券投资基金

## 五、基金的类型

契约型开放式

## 六、投资目标

在注重资产安全性和流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的稳健收益。

## 七、投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、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）、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

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，有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。

## 八、投资策略

### 1、资产配置策略

本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

本基金将主要投资于债券资产，同时密切关注股票市场的运行状况与风险收益特征，把握相对确定性的投资机会，从而达到股票、债券双盈的目标。

### 2、债券投资策略

债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

#### （1）利率预期策略

基金管理人密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势，在此基础上预测市场利率水平变动趋势，以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略如子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

#### （2）收益率曲线配置策略

收益率曲线配置策略是根据对收益率曲线形状变动的预期建立或改变组合期限结构。要运用收益率曲线配置策略，必须先预测收益率曲线变动的方向，然后根据收益率曲线形状变动的情景分析，构建组合的期限结构。

#### （3）可转债投资策略

本基金将对发行公司的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等，并参考同类公司的估值水平，判断可转换债券的股权投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的内嵌期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。基金将通过定性和定量相结合的方法对有较好盈利能力或成长前景的上市公司发行的可转债进行重点选择，同时密切跟踪上市公司的经营状况，从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面确认上市公司的转股意愿，以选择安全性和收益性俱佳的投资品种。本基金还将根据新发可转债的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转债新券的申购。

### 3、股票投资策略

本基金将采取“自下而上”的方式精选个股。本基金将全面考察上市公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本面特征，同时综合利用市盈率（P/E）、市净率（P/B）和折现现金流（DCF）等估值方法对公司的投资价值进行分析和比较，挖掘具备中长期持续增长的上市公司股票库，以获得较高投资回报。

### 4、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）

等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

#### 5、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现所资产的长期稳定增值。

#### 6、其他金融工具的投资策略

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。本基金将在有效风险管理的前提下，通过对标的品种的基本面研究，结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例，谨慎投资。

### 九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为中证全债指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%。

本基金选择中证全债指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。中证全债指数由中证指数有限公司于 2007 年 12 月 17 日正式发布，基准日为 2002 年 12 月 31 日，该指数从沪深交易所和银行间市场挑选国债、金融债和企业债组成样本券，样本券的信用评级为投资级以上，债券剩余期限为一年以上。中证全债指数综合反映了沪深证券交易所和银行间债券市场价格变动趋势，为债券投资者提供了投资分析工具和业绩评价基准。本基金选择沪深 300 指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。沪深 300 指数选样科学客观，行业代表性好，流动性高，抗操纵性强，具有良好的市场代表性和可投资性。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用，基金管理人可根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，在按照监管部门要求履行适当程序后，变更本基金

的业绩比较基准，并及时公告。

## 十、风险收益特征

本基金属于主动管理的债券型基金，为证券投资基金中的较低风险较低收益品种，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

## 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。

基金托管人中国农业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、误导性陈述或重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 12 月 31 日。

### 1、报告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	23,387,343.00	5.03
	其中：股票	23,387,343.00	5.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	391,357,053.00	84.17
	其中：债券	391,357,053.00	84.17
	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	39,964,179.95	8.59
	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	2,986,014.42	0.64
8	其他资产	7,278,580.04	1.57
9	合计	464,973,170.41	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

#### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-



C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,245,900.00	1.15
G	交通运输、仓储和邮政业	4,805,325.00	1.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	13,336,118.00	2.93
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	-	-
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	23,387,343.00	5.13

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	603233	大参林	100,400	5,245,900.00	1.15
2	600036	招商银行	134,600	5,058,268.00	1.11
3	000001	平安银行	301,000	4,951,450.00	1.09
4	600009	上海机场	61,020	4,805,325.00	1.05
5	601166	兴业银行	168,000	3,326,400.00	0.73

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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	284,961,287.50	62.51
	其中：政策性金融债	284,961,287.50	62.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	106,395,765.50	23.34

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	391,357,053.00	85.85

#### 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（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	190405	19 农发 05	2,000,000	200,260,000.00	43.93
2	018007	国开 1801	443,050	44,637,287.50	9.79
3	190206	19 国开 06	400,000	40,064,000.00	8.79
4	132018	G 三峡 EB1	328,080	36,505,461.60	8.01
5	132007	16 凤凰 EB	115,970	11,666,582.00	2.56

#### 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8、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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### （1）本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### （2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### （3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 10、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受到调查以及处罚的情况的说明

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）基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	68,890.71
2	应收证券清算款	3,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	4,163,272.33
5	应收申购款	46,417.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,278,580.04

## (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113021	中信转债	7,942,428.00	1.74
2	110053	苏银转债	7,066,878.00	1.55

## (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。基金的业绩数据截止到2019年12月31日。

### 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)
2008年11月5日(基金合同生效日) - 2008年12月31日	1.54%	0.08%	3.42%	0.26%	-1.88%	-0.18%
2009年1月1日 - 2009年12月31日	0.77%	0.23%	-1.40%	0.11%	2.17%	0.12%
2010年1月1日 - 2010年12月31日	2.52%	0.27%	3.10%	0.10%	-0.58%	0.17%
2011年1月1日 - 2011年12月31日	-10.07%	0.47%	5.88%	0.14%	-15.95%	0.33%

2012年1月1日— 2012年12月31日	16.18%	0.34%	3.52%	0.07%	12.66%	0.27%
2013年1月1日— 2013年12月31日	11.49%	0.53%	-1.07%	0.10%	12.56%	0.43%
2014年1月1日— 2014年12月31日	16.38%	0.42%	10.82%	0.09%	5.56%	0.33%
2015年1月1日— 2015年12月31日	27.77%	0.77%	8.74%	0.08%	19.03%	0.69%
2016年1月1日— 2016年12月31日	-1.67%	0.40%	2.00%	0.09%	-3.67%	0.31%
2017年1月1日— 2017年12月31日	5.01%	0.11%	-0.34%	0.06%	5.35%	0.05%
2018年1月1日— 2018年12月31日	0.10%	0.22%	8.85%	0.07%	-8.75%	0.15%
2019年1月1日— 2019年12月31日	7.11%	0.15%	4.96%	0.05%	2.15%	0.10%

### 十三、基金的费用与税收

#### 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) 基金销售服务费；
- (4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (5) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金的证券、期货交易、结算费用；
- (8) 基金的银行汇划费用；
- (9) 基金相关账户的开户及维护费用；
- (10) 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 0.7% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

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，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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，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 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### (3) 基金销售服务费

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。

上述“1、基金费用的种类”中第（4）—（10）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）本基金成立前的相关费用；
- （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。

#### 4、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集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”章节，更新了基金管理人的相关信息。
- 2、在“基金托管人”章节，更新了基金托管人的相关信息。
- 3、在“相关服务机构”章节，更新了“基金份额销售机构”的相关信息。
- 4、在“基金的投资”章节，新增了本基金投资组合报告的内容。
- 5、新增了“基金的业绩”章节，披露了基金合同生效以来的投资业绩。
- 6、新增了“其他应披露事项”章节，列出了自2019年5月6日至2020年4月30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

2020年6月10日