

## 天治量化核心精选混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2023年03月14日 送出日期：2023年03月15日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

基金简称	天治量化核心精选混合	基金代码	006877
基金简称C	天治量化核心精选混合C	基金代码C	006878
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
基金合同生效日	2019年06月11日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
李文杰	2023年02月09日		2013年06月22日

## 二、基金投资与净值表现

## (一) 投资目标与投资策略

注：本部分请阅读《天治量化核心精选混合型证券投资基金更新的招募说明书》“第九章基金的投资”了解详细情况。

投资目标	本基金通过量化策略精选股票，在严格控制风险及考虑流动性的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具、衍生工具(权证、股指期货等)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)。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为60%-95%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。</p>

主要投资策略	<p>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，通过定性与定量相结合的方法，综合考虑宏观经济、市场面、政策面等因素，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。</p> <p>2、股票投资策略：本基金股票投资策略是量化投资策略，主要是利用计算技术和数据分析验证不同投资逻辑和投资策略，然后将经过验证并具有可解释经济意义的策略应用于组合构建和实际管理过程。</p> <p>3、债券投资策略；4、权证投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7. 存托凭证投资策略</p>
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+1年期定期存款利率（税后）×20%
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。

## （二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2022年09月30日



## （三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2021年12月31日



### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	0.50%	
	N≥30天	0.00%	

#### (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	年费率1.50%
托管费	年费率0.10%
销售服务费C	年费率0.20%

### 四、风险揭示与重要提示

#### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金投资运作过程中面临的主要风险有：市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特有的风险、信用风险、操作或技术风险、合规风险、其他风险。

本基金的特定风险：1、量化策略风险2、股指期货投资风险3、资产支持证券投资风险4、投资于存托凭证的风险

## （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

基金投资者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。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后性，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.chinanature.com.cn](http://www.chinanature.com.cn)

客服电话：400-098-4800（免长途通话费用）、021-60374800

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料

## 六、其他情况说明

无。