

天治天享66个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2024年09月19日 送出日期：2024年09月20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	天治天享66个月定开债	基金代码	011850
基金管理人	天治基金管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年09月16日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式	开放频率	每66个月开放一次，开放期不少于5个工作日且最长不超过20个工作日。
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
郝杰	2021年09月16日		2011年06月01日
其他	基金合同生效后的存续期内，出现以下情况之一的，本基金可以暂停基金的运作，且无须召开基金份额持有人大会：1、每个封闭期到期前，基金管理人有权根据市场情况、基金的投资策略等决定是否进入开放期，具体安排以基金管理人公告为准。2、开放期最后一日日终，如果基金的基金资产净值加上基金开放期最后一日交易申请确认的申购确认金额及转换转入确认金额，扣除赎回确认金额及转换转出确认金额后的余额低于5,000万元或基金份额持有人数量不满200人的，基金管理人有权决定是否进入下一封闭期，具体安排以基金管理人公告为准。3、基金封闭期到期日因部分资产无法变现或者无法以合理价格变现导致基金部分资产尚未变现的，基金将暂停进入下一开放期。基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，本基金应当根据基金合同的约定进入清算程序并终止，无须召开基金份额持有人大会。本基金暂停运作时，暂停运作期间不计入上述连续期间，本基金恢复运作后重新开始计算。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

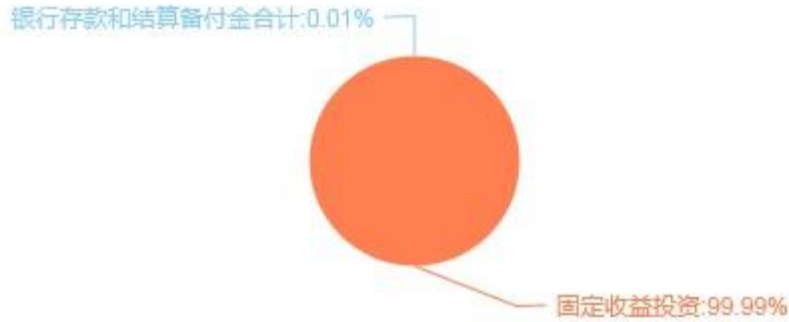
注：本部分请阅读《天治天享66个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》“第十部分基金的投资”了解详细情况。

投资目标	本基金在封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类金融工具，开放期内，主要投资于
------	--------------------------------------------------------------------

	具有较高流动性的投资品种，通过合理配置组合期限结构等方式，力求基金资产的稳健增值。
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债券（包括国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债）、债券回购、货币市场工具、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相关规定）。</p> <p>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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券比例不低于基金资产的80%（每次开放期开始前3个月、开放期及开放期结束后3个月的期间内，基金投资不受此比例限制）。开放期内应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
主要投资策略	<p>（一）封闭期投资策略：1、久期管理策略。债券积极投资策略的关键是对未来利率走向的预测。通过对利率的科学预测和对债券投资组合久期的正确把握，可以提高投资收益。</p> <p>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。</p> <p>3、杠杆策略。本基金将在封闭期内考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购进行杠杆投资，杠杆放大部分仍投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，并采取买入并持有到期的策略。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，为了保证投资组合具有较高的流动性，方便投资人安排投资，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，主要投资于具有较高流动性的投资品种，通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足投资组合流动性需求的同时，尽量减少基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	每个封闭期起始日公布的三年期银行定期存款利率（税后）+0.5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024年06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：2023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
------	---------------------------	---------	----

申购费（前收费）	M<100万	0.60%	
	100万≤M<200万	0.40%	
	200万≤M<500万	0.20%	
	M≥500万	1000.00元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	
	N≥7天	0.00元/笔	

（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/年费率或金额	收取方
管理费	0.15%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	60,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊

注：

- ①本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。
- ②本基金运作相关费用年金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

	基金运作综合费率（年化）
	0.20%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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、本基金的特定风险、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、与本基金定期开放机制相关的特定风险，在封闭期内，基金份额持有人将面临因不能赎回基金份额的风险。2、本基金采用买入并持有到期策略并采用摊余成本法估值。摊余成本法估值不等同于保本，基金资产发生计提减值准备可能导致基金份额净值下跌。基金采用买入并持有到期策略，可能损失一定的交易收益。3、本基金存在着无法存续的风险。4、基金封

闭期到期日因部分资产无法变现或者无法以合理价格变现导致基金部分资产尚未变现的，基金将暂停进入下一开放期，封闭期结束的下一个工作日，基金份额应全部自动赎回，按已变现的基金财产支付部分赎回款项，未变现资产对应赎回款延缓支付，待该部分资产变现后支付剩余赎回款。赎回价格按全部资产最终变现净额确定，最终赎回价格与封闭期到期日的净值可能存在差异。

（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

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。