

# 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）

（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：中国农业银行股份有限公司

### 重要提示

基金合同生效日期：2008年11月5日

投资有风险，投资者认购或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，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）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导致的投资风险，由投资者自行负担。本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，本基金持有现金或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。

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。

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。

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。

本次更新的招募说明书已经本基金托管人中国农业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 11 月 5 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 9 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) 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，历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、本基金基金经理

王洋女士：硕士研究生，具有基金从业资格，证券从业经验 11 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 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 日任天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。现任公司投资副总监及固定收益部总监，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。

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兼投资总监徐克磊先生，天治基金管理有限公司投资副总监兼权益投资部总监许家涵先生，天治基金管理有限公司研究发展部总监尹维国先生，天治基金管理有限公司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

### 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：32,479,411.7万元人民币

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) 基金份额发售机构

##### 1、直销机构

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：吕文龙

电话：021-60374900

传真：021-60374934

联系人：洪韦芸

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>

##### 2、代销机构

###### (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：熊奎

客户服务电话：95599

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

(5) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

传真：010-68858117

联系人：陈春林

客户服务电话：95580

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

(6) 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)

(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) 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)

(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) 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：张达洋

电话：0571-87659546

传真：87569188

联系人：毛真海

客户服务电话：95527

网址：<http://www.czbank.com/czbank/>

(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：田薇、宋明

客户服务电话：4008888888

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：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) 申万宏源证券股份有限公司

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](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：010-85130544

联系人：权唐

客户服务电话：4008888108

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

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

(16) 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、4008888111

网址：[www.newone.com.cn](http://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：薛峰

联系人：何耀

客户服务电话：10108998、4008888788

网址：[www.ebscn.com](http://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：李工

电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

联系人：甘霖

客户服务电话： 96518

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： 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](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： 许曼华

客户服务电话： 95538

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

(22) 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](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](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](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：马贤清

客户服务电话：4008888228

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

(27) 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)

(28) 国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路179号

办公地址：合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

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)

(29) 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

(30) 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

(31) 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: 0431-85096709

联系人: 安岩岩

客户服务电话: 4006000686

网址: www. nesc. cn

(32) 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

(33) 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)

(34) 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](http://www.longone.com.cn)

(35) 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](http://www.xsdzq.cn)

(36) 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.g1sc.com.cn](http://www.g1sc.com.cn)

(37) 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](http://www.cindasc.com)

(38) 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://www.jjm.com.cn>

(39) 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)

(40) 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)

(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 7-10 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（福建省外先拨 0591）

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：[www.zxwt.com.cn](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) 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：0931-96668

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

(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：0871-8898130

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

(48) 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：400-6180-315

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

(49) 西部证券股份有限公司

住所：西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

办公地址：西安市东新街 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)

(50) 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；

网址: <http://www.cfsc.com.cn/>

(51) 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)

(52) 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)

(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)

(55) 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)

(56) 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/>

(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) 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)

(62) 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)

(63) 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)

(64) 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)

(65) 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：吴强

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客服电话：95105885

网址：<http://www.10jqka.com.cn/>

(66) 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/>

(67) 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)

(68) 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 梯 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)

(69) 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)

(70) 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)

(71) 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)

(72) 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) 注册登记机构

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：上海源泰律师事务所

办公地址：上海市浦东东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海  
经办律师：廖海、刘佳  
电话：021-51150298  
传真：021-51150398  
联系人：廖海

#### （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  
电话：(021) 22288888  
传真：(021) 22280000  
联系人：蒋燕华  
经办会计师：蒋燕华、石静筠

#### 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、基金的投资目标

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、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，包括国内依法发行上市的债券、股票、权证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。此外，如法律法

规或中国证监会允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金债券类资产（包括国债、金融债、企业债、可转换债券、资产支持证券、央行票据、债券回购等）的投资比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，本基金持有现金或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。

## 八、基金的投资策略

本基金根据宏观经济运行状况、货币政策及利率走势的综合判断，运用自上而下的资产配置与品种选择策略，结合债券投资业绩比较基准合理控制组合久期的波动范围，在全面评估利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上，充分运用各种套利策略提升组合的持有期收益率，实现基金的保值增值。此外，本基金在对新股的定价因素和预期因素进行综合考察的前提下，积极参与一级市场申购，获得较为安全的新股申购收益；本基金保留在股票市场系统性风险较低而且整体动态估值水平合理的前提下进行股票二级市场投资的选择权。

### 1、债券投资策略

#### （1）债券资产配置

##### 1) 久期管理

本基金以债券投资业绩比较基准中证全债指数的久期为参照进行适度偏离，合理控制组合久期的波动范围。根据对利率水平的预期，在预期利率下降时，相对于债券投资业绩比较基准适度增大组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，相对于债券投资业绩比较基准适度减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

##### 2) 期限结构配置

本基金将以久期波动范围为约束条件，结合收益率曲线变化的预测，适当选择采用子弹组合、杠铃组合和梯形组合，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

##### 3) 类属券种配置

本基金根据国债、金融债、企业债、资产支持证券和可转换债券之间的相对价值，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾特定类属收益的基本面分析，确定整个债券组合中类属债券投资比例。

#### (2) 债券品种选择

在资产配置比例基本确定的基础上，本基金选择剩余期限和信用等级符合标准、流动性高、价值被低估的投资品种。其中，资产流动性通过二级市场存量、日均交易量、上市时间等指标加以判断，资产价值通过利率期限结构、持有期总收益等指标评价。

具有以下一项或多项特征的债券，将是本基金重点关注的对象：

- 1) 在类似信用质量和期限的债券中到期收益率较高的债券；
- 2) 风险水平合理、有较好的下行保护的债券；
- 3) 有较好流动性的债券；
- 4) 预期信用质量将得到改善的金融债或企业（公司）债券；
- 5) 有较高当期收入的债券；
- 6) 其他有增值潜力、价格被低估的债券。

#### (3) 可转债投资

可转债兼具债券和股票的特性，本基金将根据可转债在不同市场环境下股性和债性的相对变化进行合理的市场定价分析，选择相应券种，以获取相对较高的投资收益。本基金还将结合可转债发行主体所属行业、财务结构、经营业绩、经营效率等基本面因素对可转债进行债权价值评估和期权价值评估，以作为可转债品种选择的基础。

#### (4) 债券套利策略

本基金将充分利用以下无风险套利机会有效提高债券资产盈利水平：

- 1) 利用同一债券品种在不同债券市场上的价格差异，通过无风险套利操作，获得由于市场分割带来的超额收益；
- 2) 利用同期限债券回购品种在不同市场上的利率差异，通过开展无风险套利操作，提高投资组合的盈利能力；
- 3) 利用同期限债券品种在一、二级市场上的收益率差异，通过投资品种的转换，获得一、二级市场的差价收入。

### 2、股票投资策略

本基金根据债券市场和股票市场的系统性风险的判断以及新股申购收益率的预测，以价值投资原则来确定股票总体投资比例以及股票一级市场和二级市场各自的投资比

例。

### (1) 一级市场投资策略

本基金将把握我国股票一级市场和二级市场定价差异所产生的投资机会，在保证基金资产流动性和安全性的前提下，积极参与新股上市溢价收益，有效提高基金资产的收益性。

本基金通过考察各种定价因素和预期因素决定是否参与新股申购以及参与金额。通过定价因素分析，确定合理的新股预期价格，作为参与新股申购和判断新股上市后股价是否处于合理估值水平的主要依据。通过预期因素分析，避免新股上市后由于市场波动、行业估值水平下降、公司财务状况恶化等情况导致股价产生较大的下跌风险以及新股上市后成交不活跃导致的流动性风险。

在一般情况下，本基金获配新股将在上市首日或者解禁首日卖出，以保证基金整体资产的流动性和安全性；如果获配新股满足二级市场投资标的的特征且价格明显低于合理估值水平，则持有至合理价格卖出。

### (2) 二级市场投资策略

本基金主要运用自下而上精选个股的策略来进行股票二级市场投资，同时对个股集中度和行业集中度进行合理控制以分散个股风险和行业风险，以价值投资获取稳健的股票二级市场投资收益。在没有合适投资标的的情况下，本基金将不进行二级市场股票投资，投资标的必须同时具备以下两个方面的特征：

- 1) 具有较高的行业领先度，经营规模、盈利能力、管理水平居于行业领先地位；
- 2) 具有较高的市场领先度，估值水平、成长确定性、流动性优于市场平均水平。
- 3、衍生工具投资策略

本基金可以持有股票所派发的权证、可分离债券产生的权证。

随着未来利率期货、利率期权、利率互换等可以有效规避利率风险金融衍生产品的推出，本基金将在监管部门批准后积极开展套利操作。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为中证全债指数收益率。

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

本券的信用级别为投资级以上，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。

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，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、基金的风险收益特征

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              | 34,857,974.00  | 16.46        |
|    | 其中：股票             | 34,857,974.00  | 16.46        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 172,470,762.16 | 81.46        |
|    | 其中：债券             | 172,470,762.16 | 81.46        |
|    | 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      | 1,525,549.61   | 0.72         |
| 8  | 其他资产              | 2,882,214.27   | 1.36         |
| 9  | 合计                | 211,736,500.04 | 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              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 6,371,440.00  | 3.02         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,176,902.00  | 1.03         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 6,000,417.00  | 2.85         |
| 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              | 20,309,215.00 | 9.63         |
| 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               | 34,857,974.00 | 16.53        |

## 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  | 601398 | 工商银行 | 1,189,500.00 | 6,863,415.00 | 3.25         |
| 2  | 601939 | 建设银行 | 940,000.00   | 6,805,600.00 | 3.23         |
| 3  | 601988 | 中国银行 | 1,785,000.00 | 6,640,200.00 | 3.15         |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 8,728.00     | 6,371,440.00 | 3.02         |
| 5  | 600009 | 上海机场 | 102,100.00   | 6,000,417.00 | 2.85         |
| 6  | 600900 | 长江电力 | 132,900.00   | 2,176,902.00 | 1.03         |

## 4、期末按券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      | 157,343,200.00 | 74.61        |
|    | 其中：政策性金融债 | 157,343,200.00 | 74.61        |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 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) | 15,127,562.16  | 7.17  |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 172,470,762.16 | 81.78 |

#### 5、基金投资前五名债券明细

| 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  | 180202 | 18国开02 | 500,000 | 50,745,000.00 | 24.06        |
| 2  | 180208 | 18国开08 | 400,000 | 40,412,000.00 | 19.16        |
| 3  | 170209 | 17国开09 | 200,000 | 20,218,000.00 | 9.59         |
| 4  | 150220 | 15国开20 | 200,000 | 19,962,000.00 | 9.47         |
| 5  | 018005 | 国开1701 | 157,000 | 15,794,200.00 | 7.49         |

#### 6、期末基金投资前五名权证明细

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没有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   | 19,578.71    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,847,553.56 |
| 5  | 应收申购款   | 15,082.00    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,882,214.27 |

#### (4) 期末本基金持有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 | 123003 | 蓝思转债 | 1,214,606.16 | 0.58 |
|---|--------|------|--------------|------|

### (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。

## 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<br>(1) | 净值增长<br>率标准差<br>(2) | 业绩比较<br>基准收益<br>率(3) | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>(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9月30日             | 1.19%        | 0.21%               | 5.76%                | 0.08%                       | -4.57%  | 0.13%   |

## 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；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金销售服务费；
- (4) 基金合同生效后的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (7) 基金的证券交易、结算费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- (8) 基金财产拨划支付的银行费用；
- (9) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

## 2、与基金运作有关费用的计提方法、计提标准和支付方式

### (1) 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{本基金年管理费率为 } 0.7\%$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{本基金年托管费率为 } 0.2\%$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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

本基金销售服务费用于本基金的销售与基金份额持有人服务等。

在通常情况下，基金销售服务费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如

下：

$H = E \times 年基金销售服务费率 \div 当年天数$ ，本基金的年基金销售服务费率为 0.3%

H 为每日应计提的基金销售服务费

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。

(4) 上述 1 中 (4) 到 (9) 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### 3、与基金销售有关的费用

与基金销售有关的费用为申购费、赎回费和转换费，该费用具体的计算公式、费率水平参见本招募说明书第八条。

## 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方法》、《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 15 日公布的《天治稳健双盈债券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，更新了“基金管理人概况”和“主要人员情况”的相关内容。
- 2、在“基金托管人”中，对“基金托管人情况”等信息进行了更新。
- 3、在“相关服务机构”中，更新了有关代销机构的相关信息。
- 4、在“基金的投资”中，对“投资决策流程”和“基金投资组合报告”进行了更新。
- 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“基金托管协议当事人”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 5 月 6 日至 2018 年 11 月 5 日期间与本基金和基金管理人有关的公告。

天治基金管理有限公司

2018 年 12 月 19 日