天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书（摘要）

（2020年）

基金管理人：天治基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
二〇二〇年八月

重要提示

天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）于2005年8月3日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2005]134号文核准公开募集。本基金的基金合同于2006年1月20日正式生效。

本基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者拟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，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、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引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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8月15日，有关财务数据和净值表现截止日为2020年6月30日（财务数据未经审计）。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行。

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：单宇

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

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，历任北京市政府对外服务办公室、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，经济师职称。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员、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。

牛蓼女士：监事，本科学历，高级经济师职称。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、监察稽核部副总监，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、本基金基金经理

许家涵先生：经济学、文学双学士，具有基金从业资格，证券从业经验15年。2005年7月至2007年9月就职于吉林省信托有限责任公司任自营资金部职员，2007年9月至今就职于天治基金管理有限公司，历任交易员、交易部总监助理、交易部副总监、交易部总监，现任权益投资部总监，2015年6月2日起任本基金的基金经理，2019年2月28日起任天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019年7月23日起任天治财富增长证券投资基金的基金经理。

本基金历任基金经理：2006年1月20日（基金合同生效日）至2008年10月31日，余明元先生任基金经理；2006年9月14日至2007年4月12日，吴鹏先生任基金经理；2008年4月11日至2011年9月9日，吴涛先生任基金经理。2010年12月31日至2015年6月12日，秦海燕女士任基金经理。

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，研究总监严雄国先生，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

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号
注册时间：1987年3月30日
注册资本：742.63亿元
法定代表人：彭纯
联系人：陆志俊
电话：95559

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

（1）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：陈旭
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

（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

（3）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：贺倩
客户服务电话：95599
网址：www.abchina.com 、www.95599.cn

（4）兴业银行股份有限公司
住所：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

（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

（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

（8）上海银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路168号
办公地址：上海市辅东新区银城中路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：http://www.bosc.cn/

（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号北京银行大厦
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）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：4008－888－888或95551
网址：www.chinastock.com.cn

（11）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
服务热线：95521 / 4008888666

（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

（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：010－85156398
联系人：许梦园
客服电话：95587、4008－888－108
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：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

（15）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

（16）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：021－38565547
联系人：乔琳雪
客户服务电话：95562
网址：www.xyzq.com.cn

（17）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

（18）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

（19）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

（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：刘萍
客户服务电话：95372
网址：www.jyzq.cn

（21）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
法定代表人：章宏韬
电话：0551－65161821
传真：0551－65161600
联系人：范超
客户服务电话：95318
网址：www.hazq.com

（22）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

（23）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：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：0531－68889095
联系人：秦雨晴
客户服务电话：95538
网址：www.zts.com.cn

（24）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

（25）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

（26）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

（27）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22－2
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

（28）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

（29）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

（30）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

（31）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、www.jjm.com.cn

（32）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：021－20655017
传真：021－20655196
联系人：刘晨
客户服务电话：96326
网址：http://www.hfzq.com.cn

（33）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

（34）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

（35）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
法人代表：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

（36）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

（37）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

（38）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

（39）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

（40）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

（41）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：李琦
电话：0991－2307105
传真：0991－2301927
联系人：王怀春
客户服务电话：4008000562
网址：www.hysec.com

（42）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

（43）国都证券有限责任公司
住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：常喆
联系电话：010－84183333
联系人：黄静
客户服务电话：400－818－8118
网址：www.guodu.com

（44）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

（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

（46）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
华鑫证券公司网站：www.cfsc.com.cn

（47）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

（48）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

（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

（50）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

（51）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：李珍珍
客户服务电话：4008－773－772
网址：www.5ifund.com

（52）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/

（53）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

（54）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：高静
客户服务电话：400－678－5095
网址：www.niuji.net

（55）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：400－118－118
网址：www.66zichan.com

（56）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

（57）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

（58）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 、www.jjmmw.com

（59）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

（60）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

（61）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

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京西城区太平桥大街17号恒奥中心A座
法定代表人：周明
电话：010－50938931
传真：010－50938907
联系人：徐一文

（三）律师事务所

名称：上海源泰律师事务所
住所：上海浦东南路256号华夏银行大厦14层
负责人：廖海
经办律师：廖海、田卫红
电话：021－51150298
联系人：廖海

（四）会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
法定代表人：毛鞍宁
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
签章会计师：蒋燕华、石静筠
电话：021－22288888
传真：021－22280000
联系人：蒋燕华

四、基金的名称

天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

契约型上市开放式

六、基金的投资目标

通过将部分资产投资于品质优良、成长潜力高于平均水平的中小型上市公司股票，并将部分资产用于复制大型上市公司股票指数（富时中国A200指数）的业绩表现，在控制相对市场风险的前提下，追求中长期的资本增值。

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，包括国内依法公开发行上市的各类股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

八、基金的投资策略

本基金以股票品种为主要投资标的，以“核心－卫星”策略作为股票投资的总体策略。“核心－卫星”策略是指将股票资产分为核心组合和卫星组合，核心组合通过跟踪指数进行被动投资，控制投资组合相对于市场的风险；卫星组合通过优选股票进行主动投资，追求超越市场平均水平的收益。本基金的核心组合用于跟踪大型公司股票指数（富时中国A200指数），卫星组合用于优选中小型成长公司股票。本基金的投资策略包括以下几个层面：

1、股票投资策略

（1）“核心－卫星”策略

本基金通过“核心－卫星”策略将被动投资策略和主动投资策略有效结合起来，融合被动投资（核心组合）长期收益稳定、低风险、低成本和主动投资（卫星组合）具有获取超额收益机会的优势。核心组合对大型公司股票指数——富时中国A200指数进行优化复制，通过低成本的指数化投资，分享中国经济增长下大型公司的长期稳定收益，降低股票资产的整体风险；卫星组合将积极选股对象限定为中小型成长股，以获取优质高成长公司所带来的超额收益。

在一股情况下，本基金的资产类别配置的范围为：股票投资比例为基金净资产的60%－95%，其中，核心组合的投资比例为股票资产净值的55%－65%，卫星组合的投资比例为股票资产净值的35%－45%；债券投资比例为基金净资产的0%－40%，现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具不低于基金净资产的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（2）核心组合投资策略：指数投资

本基金的核心组合选择富时中国A200指数作为跟踪标的，进行指数化投资，以期获取该指数所代表的市场组合的平均收益。富时中国A200指数前身为2001年7月26日开始由新华富时指数公司发布的‘新华富时中国A200指数’，于2010年12月更名为‘富时中国A200指数’。该指数包含深沪两个市场中经过自由流通量和流动性检测合格的、总市值排名前200家的大型上市公司，涵盖36个行业。

在剔除基本面恶化、投资价值降低的成份股的基础上，本基金采用有约束条件的最小跟踪误差优化算法进行指数跟踪。在投资的全过程中，本基金对核心组合与富时中国A200指数的偏离风险进行实时跟踪和评估，力争将年化跟踪误差控制在4%以内。

（3）卫星组合投资策略：中小型成长股优选策略

本基金的卫星组合采用主动性投资策略，通过建立公司成长性评估系统，在深入研究的基础上发现并投资于具有良好成长性的中小型公司股票，以捕获超越市场平均水平的获利机会。

本基金中小型成长股组合构建流程如下：

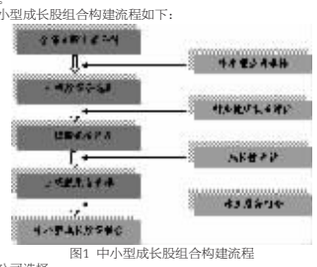

图1 中小型成长股组合构建流程

①中小型公司选择

对于中国A股市场中的所有上市公司，按其总市值升序排列，并计算各公司所对应的累计总市值占全部公司累计总市值的百分比，将所对应的累计总市值百分比处在[0%，40%]的公司定义为中小型公司。本基金选择上述定义的中小型公司股票，建立一级股票备选库。

由于新股发行等因素导致A股市场市值规模分布发生较大变动时，本基金可对上述定义的中小型公司规模进行重新界定。

②财务健康状况评价

在剔除法律法规和公司制度明确禁止投资的股票，包括涉及关联方交易的公司、ST公司、*ST公司、出现法律问题或财务问题以及存在股份操纵嫌疑等公司的基础上，主要通过考察上市公司利润结构、持续性利润水平等，剔除盈利质量和经营现金质量较差的上市公司，选出财务健康的上市公司，建立二级股票备选库。

③成长性评估

在财务健康状况评价的基础上，运用上市公司成长性评估系统，通过对上市公司进行深入分析和实地调研，筛选具有良好持续成长性的股票，建立三级股票备选库。

上市公司成长性评估以宏观分析和行业分析作为评估的基础，对公司内部因素进行深刻理解和分析，预测其未来的成长性，从而优选出品质优良、成长潜力高于平均的上市公司。上市公司成长性评估包括宏观环境分析、行业前景分析、公司显在因素分析和公司潜在因素分析四个组成部分。

宏观环境分析：通过分析经济周期所处阶段、宏观政策以及产业政策等因素，判断公司主业是否具有广阔的潜在成长空间。

行业前景分析：通过分析公司所处行业的生命周期和是否具有稳定增长的市场需求，对公司未来成长的关键驱动因素进行考察。

公司显在因素分析：在考察上市公司历史成长性的基础上预测其未来成长性。主要运用主营业务收入增长率、扣除非经常损益后的净利润增长率、主营业务利润率、净资产收益率、每股自由现金流量等指标，通过交叉分析，对上市公司的历史成长性进行综合考察。其中，主营业务利润率和扣除非经常损益后的净利润增长率均为70%置信度下过去3年（包括年度与半年度）的增长率，即扣除了增长率中风险因素之后、在下期有70%把握达到的可信增长率。在历史成长性基础上，预测公司未来两年的每股主营业务收入增长率（SG）等指标，通过与行业平均水平和市场平均水平的比较来判断公司未来成长性，并根据预期的股价每股主营业务收入比（P/S）等指标确定最佳投资时机。

公司潜在因素分析：主要通过分析公司主导产品的市场占有率、成本控制力、技术领先性、管理团队的历史业绩、决策力、开拓性、稳定性以及公司的研发能力、营销网络等定性因素，判断公司是否具有将未来成长性转化为现实成长性的潜质。

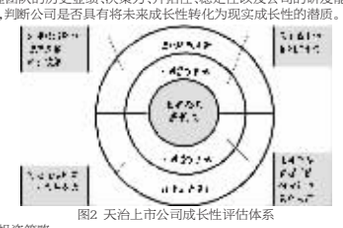

图2 天治上市公司成长性评估体系

2、债券投资策略

本基金为了在一定程度上规避股票市场的系统性风险和满足基金资产的流动性要求，将小部分基金资产投资于国债、金融债、企业债、可转债、央行票据等债券品种。债券投资在综合考虑宏观经济因素和债券品种特征因素的基础上，运用利率预期、久期管理、收益率利差分析、套利交易等策略进行债券久期配置、类属配置，获取债券市场的长期稳定收益。

九、基金的业绩比较基准

富时中国A全指×75%＋富时中国国债指数×25%。

十、基金的风险收益特征

本基金为具有中等风险、中高收益的混合型基金，风险收益特征介于大盘平衡型基金和小盘成长型基金之间。

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。

基金托管人交通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2020年6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	561,332,533.20	93.01
	其中：股票	561,332,533.20	93.01
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	14,922,350.00	2.47
	其中：债券	14,922,350.00	2.47
	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	25,832,287.72	4.28
8	其他资产	1,462,837.22	0.24
9	合计	603,550,008.14	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	29,296.00	0.00
C	制造业	479,766,683.80	80.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	－	－
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、软件和信息技术服务业	64,647,767.08	10.83
J	金融业	－	－
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	16,876,020.00	2.83
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	561,332,533.20	93.99

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	603158	腾龙股份	2,387,724	53,795,421.72	9.01
2	002475	立讯精密	1,012,417	51,987,612.95	8.71
3	300136	信维通信	838,000	44,430,760.00	7.44
4	002241	歌尔股份	1,333,700	39,157,432.00	6.56
5	002007	华兰生物	780,000	39,085,800.00	6