天治核心成长股票型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书（摘要）

（2013年第1次更新）

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

重要提示

天治核心成长股票型证券投资基金（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。

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。

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。

本次更新的招募说明书已经本基金托管人交通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2013年1月20日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年12月31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：赵玉彪

5、办公地址：上海市复兴西路159号

6、电话：021-60371155

7、联系人：张丽红

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7800万元，占注册资本的48.75%；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%；吉林市国有资产经营有限责任公司出资2000万元，占注册资本的12.50%。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理层成员

高福波先生：董事长，研究生学历，高级经济师，历任吉林省白山市人民银行任办公室主任、副行级助理稽察、吉林省白山市农村信用联社任理事长、党委书记、吉林省农村信用联社任资金信贷处负责人、副主任，现任吉林省信托有限责任公司党委书记、董事长、天治基金管理有限公司董事长。

王铁锋先生：副董事长，博士后，教授，历任中国科学院近代物理研究所助理研究员、海南民源现代农业发展股份有限公司董事长助理、董事会秘书、海南省国际信托投资公司资产管理部及投资银行总部副总经理、华宝信托投资有限责任公司及联合证券有限责任公司副总裁、中国民族证券有限责任公司、金元证券股份有限公司执行总裁、首都机场集团公司总经理助理兼北京首都国际机场股份公司执行董事、财务总监、香港沿海国际控股公司、上海丰华（集团）股份有限公司执行董事兼上海丰华董事长，现任首都机场集团公司首席顾问、上海国家会计学院金融中心主任、教授、吉林大学商学院教授、博士生导师、天治基金管理有限公司副董事长。

柏广新先生：董事，博士，高级经济师，历任吉林省黄泥河林业局副局长、党委书记，中共吉林省延边朝鲜族自治州委员会宣传部常务副部长，延边州人民政府副秘书长，延边州林业管理局局长兼吉林延边林业集团董事长，现任吉林森工集团有限责任公司董事长、党委书记，全国人大代表。

赵玉彪先生：董事、总经理，硕士，历任吉林省信托有限责任公司上海证券业务部交易部经理、吉林省信托有限责任公司上海洪山路证券营业部经理兼驻上海证券交易所出市代表、上海金路达投资管理有限公司总经理、天治基金管理有限公司董事长，现任天治基金管理有限公司总经理。

李洁思女士：独立董事，自1991年7月至2007年12月在吉林省延边朝鲜族自治州政府工作。在工作期间曾任延边州政府副秘书长、副州长、常务副州长，分管过政法、经济、金融等工作，现已退休。

刘星星先生：独立董事，研究生、博士学位，高级咨询师，历任北京大学经济系讲师、The Monitor Company管理顾问、嘉实基金管理有限公司管理顾问，现任北京威兰德企业管理顾问有限公司董事长。

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、现任吉林省保险行业协会中介部主任。

侯丹宇女士：监事会主席，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长。

邱荣生先生：监事，研究生学历，高级经济师，历任吉林省财政厅预算处科员、科长、副处长，香港振兴投资公司副总经理，吉林省财政厅副主任，吉林省信托有限责任公司工作办公室主任、财务部经理、总经理助理、副总经理，现任吉林省信托有限责任公司党委副书记、董事、总经理。

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。

唐庆敏先生：监事，本科学历，历任吉林市国资局工交科科长、吉林市财政局企业二处处长、吉林市国资公司董事。

白宇先生：监事，大学本科学历，助理经济师职称，2003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交易部副总监。

闫译文女士：副总经理，吉林大学法学硕士，高级经济师，注册会计师，曾就职于吉林省信托有限责任公司，任下属公司财务主管、公司行政主管、业务部经理、党委委员、职工董事等职务，现任天治基金管理有限公司副总经理。

赵明女士：副总经理，经济学学士，历任辽宁东方证券公司客户经理、沈阳渤海投资咨询有限责任公司经理、沈阳天和信息技术有限公司市场部经理、天治基金管理有限公司市场营销部总监、宏源证券股份有限公司北京资产管理分公司副总经理，现任天治基金管理有限公司副总经理。

陈志峰先生：副总经理，硕士，历任上海银行会计、北大方正电子有限公司财务部会计、华安基金管理有限公司市场部销售经理、汇丰晋信基金管理有限公司渠道部副总监、光大保德信基金管理有限公司销售部渠道主管、销售部总监，现任天治基金管理有限公司副总经理。

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

秦海燕女士：理学硕士研究生，具有基金从业资格，证券从业经验6年。2006年6月加入天治基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理，2010年5月28日起任天治品质优选混合型证券投资基金的基金经理，2010年12月31日起兼任本基金的基金经理。

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。

3、投资决策委员会成员

天治基金管理有限公司总经理助理兼投资总监常永涛先生，权益投资部副总监兼天治创新先锋股票型证券投资基金基金经理陈勇先生，固定收益部总监兼天治稳健双盈债券型证券投资基金、天治稳定收益债券型证券投资基金基金经理秦娟女士，研究发展部总监兼天治品质优选混合型证券投资基金基金经理、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理吴战峰先生。

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：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

注册时间：1987年3月30日

注册资本：618.85亿元

法定代表人：胡怀邦

电话：021-32169999

联系人：裴学敏

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

天治基金管理有限公司直销中心
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：赵玉彪
电话：021-60371155
传真：021-60374934
联系人：王露易，王珊珊
客户服务电话：400-098-4800（免长途通话费用）、021-34064800
网址：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/

2、代销机构

（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：上海市银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
电话：021-58781234
传真：021-58408483
联系人：陈铭铭
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(长安兴融中心)
法定代表人：王洪章
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：项俊波
传真：010-85109219
联系人：刘一宁
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：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
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
法定代表人：孔丹
电话：010-65558888
传真：010-65550827
联系人：郭伟
客户服务电话：95558
网址：www.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：董文标
电话：010-57092615
传真：010-57092611
联系人：董云巍
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：上海市银城中路168号
办公地址：上海市银城中路168号
法定代表人：范一飞
电话：021-68475888
传真：021-68476111
联系人：夏雪
客服电话：021-962888
网址：www.bankofshanghai.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
法定代表人：闫冰竹
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：陈有安
电话：010-66568430
传真：010-66568990
联系人：田薇
客户服务电话：4008888888
网址：www.chinastock.com.cn

（11）国泰君安证券股份有限公司
住所：上海市浦东新区商城路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：万建华
联系人：芮敏祺
客户服务电话：4008888666
网址：www.gtja.com

（12）海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
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
联系人：李笑鸣
客户服务电话：95553、4008888001
网址：www.htsec.com

（13）中信建投证券有限责任公司
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：张佑君
联系人：权唐
客户服务电话：400-8888-108
网址：www.csc108.com

（14）申银万国证券股份有限公司
住所：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
电话：021-54033888
传真：021-54038844
联系人：李清怡
客户服务电话：021-962505
网址：www.sw2000.com.cn

（15）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：宫少林
电话：0755-83734343
传真：0755-82943636
联系人：林生迎
客户服务热线：95565、4008888111
网址：www.newone.com.cn

（16）兴业证券股份有限公司
住所：福建省湖东路268号
办公地址：上海市浦东民生路1199弄证大·五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
联系人：谢高得
客户服务电话：4008888123
网址：www.xyzq.com.cn

（17）华泰证券股份有限公司
住所：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025-84457777
联系人：万鸣
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

（18）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、4008888555
网址：www.lhzq.com

（19）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

（20）山西证券股份有限公司
住所：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔
办公地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔
法定代表人：侯巍
联系人：郭熠
客户服务电话：4006661618
网址：www.i618.com.cn

（21）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：陆涛
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

（22）华安证券有限责任公司
住所：安徽省合肥市长江中路357号
办公地址：安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座24-32层
法定代表人：李工
电话：0551-5161821
传真：0551-5161672
联系人：甘霖
客户服务电话：96518、4008096518
网址：www.huaans.com

（23）万联证券有限责任公司
住所：广州市越秀区中山二路18号广东电信广场36—37层
办公地址：广州市越秀区中山二路18号广东电信广场36—37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

（24）齐鲁证券有限公司
住所：山东省济南市经十路86号
办公地址：山东省济南市千佛山路经十路86号23层
法定代表人：李玮
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
联系人：吴阳
客户服务电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

（25）光大证券有限责任公司
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：徐浩明
联系人：刘晨
客户服务电话：10108998；4008888788
网址：www.ebscn.com

（26）广发证券股份有限公司
住所：广州天河区天河北路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
联系人：黄岚
客户服务电话：95575或致电各地营业网点
网址：www.gf.com.cn

（27）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：林俊波
联系人：钟康莺
电话：021-68634518
传真：021-68865680
客户服务电话：400-888-1551
网址：www.xcsc.com

（28）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：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
联系电话：400-886-6338
传真：0755-82450826
联系人：郑舒丽
客户服务电话：95511
网址：www.pingan.com

（29）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

（30）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.glsc.com.cn

（31）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：张志刚
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

（32）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：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
传真：010-66045500
联系人：林爽
客户服务电话：010-66045678
网址：http://www.txsec.com、http://jijin.txsec.com

（33）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至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
网址：www.hfzq.com.cn

（34）中信证券股份有限公司
住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
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：010-60833799
传真：010-60833739
联系人：陈忠
客户服务电话：95558
网址：www.cs.ecitic.com

（35）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：张智河
电话：0532-85022326
联系人：吴忠超
客户服务电话：96577
网址：http://www.zxwt.com.cn

（36）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：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19-20层
法定代表人：沈强
电话：0571-87112510
联系人：丁思聪
客户服务电话：0571-96598
网址：http://www.bigsun.com.cn

（37）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：胡运钊
电话：027-65799999
传真：027-85481900
联系人：李良
客户服务电话：4008888999
网址：www.95579.com

（38）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
联系电话：0551－2272101
联系人：李蔡
客服电话：95578
网址：www.gyzq.com.cn

（39）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

（40）东北证券股份有限公司
住所：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
电话:0431-85096709
联系人：潘锴
客户服务电话：4006000686
网址：www.nesc.cn

（41）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

（42）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18-19楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人：朱科敏
电话：0519-88157761
联系人：李涛
客户服务电话：4008888588
网址：www.longone.com.cn

（43）宏源证券股份有限公司
住所：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
电话：010-88085858
传真：010-88085195
联系人：李巍
客户服务电话：4008000562
网址：www.hysec.com

（44）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
网址：www.ajzq.com

（45）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

（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：北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人：陈耀先
电话：010-58598835
传真：010-58598907
联系人：任瑞新

（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：葛明
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址：上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
签章会计师：严盛炜、戴维维
电话：021-22288888
传真：021-22280000
联系人：戴维维

四、基金的名称

天治核心成长股票型证券投资基金（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。

在一般情况下，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%。

（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：

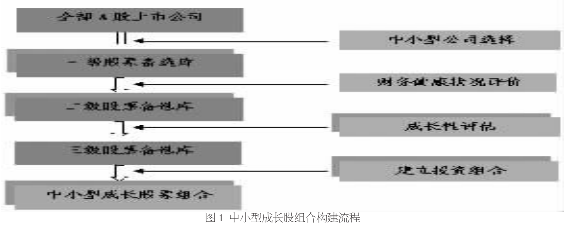


图1 中小型成长股组合构建流程

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价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。

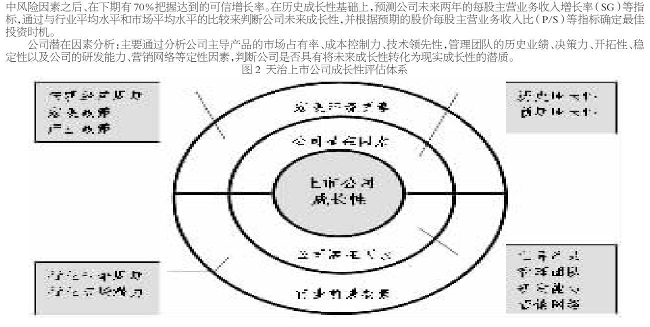
宏观环境分析：通过分析经济周期所处阶段、宏观政策以及产业政策等因素，判断公司主业是否具有广阔的潜在成长空间。

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、中高收益的股票型基金，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2012年12月31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	1,986,833,009.83	86.03
	其中：股票	1,986,833,009.83	86.03
2	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	298,868,137.25	12.94
6	其他资产	23,713,517.15	1.03
7	合计	2,309,414,664.23	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	24,410,112.00	1.07
B	采掘业	41,490,000.00	1.82
C	制造业	905,112,987.32	39.81
C0	食品、饮料	124,384,675.91	5.47
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	102,175,008.54	4.49
C5	电子	69,210,081.15	3.04
C6	金属、非金属	166,837,019.63	7.34
C7	机械、设备、仪表	300,544,235.49	13.22
C8	医药、生物制品	141,961,966.60	6.24
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	31,738,320.00	1.40
E	建筑业	215,157,876.77	9.46
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	95,112,109.32	4.18
H	批发和零售贸易	66,780,365.29	2.94
I	金融、保险业	261,810,982.00	11.51
J	房地产业	270,507,740.53	11.90
K	社会服务业	74,712,516.60	3.29
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	1,986,833,009.83	87.38

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	600048	保利地产	7,366,728	100,187,500.80	4.41
2	600887	伊利股份	4,438,590	97,560,208.20	4.29
3	002081	金螳螂	1,635,916	72,013,022.32	3.17
4	600000	浦发银行	7,000,000	69,440,000.00	3.05
5	000651	格力电器	2,400,000	61,200,000.00	2.69
6	601166	兴业银行	3,600,000	60,084,000.00	2.64
7	600837	海通证券	5,785,000	59,296,250.00	2.61
8	002241	歌尔声学	1,567,425	59,091,922.50	2.60
9	000538	云南白药	858,171	58,355,628.00	2.57
10	600104	上汽集团	3,300,000	58,212,000.00	2.56

4、期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、基金投资前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

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）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	2,750,000.00
2	应收证券清算款	20,655,758.19
3	应收股利	–
4	应收利息	66,669.09
5	应收申购款	241,089.87
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	23,713,517.15

（4）期末本基金持有处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（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
2006年1月20日–2006年12月31日	75.78%	1.32%	75.76%	1.07%	0.02%	0.25%
2007年1月1日–2007年12月31日	126.33%	2.03%	120.24%	1.73%	6.09%	0.30%
2008年1月1日–2008年12月31日	-57.31%	2.13%	-45.74%	2.30%	-11.57%	-0.17%
2009年1月1日–2009年12月31日	50.60%	1.61%	76.26%	1.53%	-25.66%	0.08%
2010年1月1日–2010年12月31日	1.28%	1.48%	-3.04%	1.17%	4.32%	0.31%
2011年1月1日–2011年12月31日	-25.18%	1.23%	-19.96%	1.01%	-5.22%	0.22%
2012年1月1日–2012年12月31日	11.73%	1.08%	4.55%	1.01%	7.18%	0.07%

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

本基金的管理费按基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.2%÷当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2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、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按基金资产净值的2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×2.5‰÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（3）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

（4）证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金合同生效后的会计师费和律师费、基金份额持有人大会费用、基金上市的费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等根据有关法规及相关合同的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

（5）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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

2、与基金销售有关的费用

（1）认购费

本基金的认购包括场内认购和场外认购两种方式。本基金场外认购费率如下：

认购金额M（含认购费）	认购费率
M<25万元	1.0%
25万元≤M<100万元	0.6%
100万元≤M<500万元	0.3%
M≥500万元	每笔1000元

投资人场内认购的券商佣金比率由深圳证券交易所会员单位按照本基金招募说明书中约定的场外认购的认购费率设定。

认购费将用于支付发售期间审计费、律师费、注册登记费、销售费及市场推广等费用。募集期间发生的各项费用不从基金财产中列支。

（2）申购费

本基金的申购包括场内申购和场外申购两种方式。申购费率不高于1.5%，随申购金额的增加而递减，具体费率如下表所示：

申购金额（M，含申购费）	申购费率
M<25万元	1.5%
25万元≤M<100万元	1.0%
100万元≤M<500万元	0.5%
M≥500万元	每笔收取1200元

申购费由申购人承担，可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

（3）赎回费

本基金的赎回包括场内赎回和场外赎回两种方式。场内赎回费率统一为0.5%，场外赎回费率根据投资人持有本基金时间的增加而递减，具体费率如下表所示：

持有期限(N)	赎回费率
N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.3%
N≥2年	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费用的75%用于注册登记费及相关手续费等，25%归入基金财产。

（4）申购赎回费率的调整

基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费用和赎回费用标准，调整后的申购费用和赎回费用标准在最新的招募说明书中列示。上述费用标准如发生变更，基金管理人最迟应于新的费用标准实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

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2012年9月1日公布的《天治核心成长股票型证券投资基金（LOF）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，对基金管理人电话、董事、监事、经理层成员、投资决策委员会成员信息进行了更新。

2、在"基金托管人"中，对基金托管人概况、主要人员情况、基金托管业务经营情况等信息进行了更新。

3、在"相关服务机构"中，更新了直销机构、代销机构、会计师事务所的相关信息。

4、在"基金的投资"中，更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。

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"其他应披露事项"中，列出了自2012年7月21日至2013年1月20日期间与本基金和本基金管理人有关的公告。

7、更新了招募说明书中基金管理人的相关联系电话、传真、客户服务电话等信息。

天治基金管理有限公司
2013年3月5日

关于调整上投摩根分红添利债券型证券投资基金赎回费率的公告

为提高基金资产的运作效率，保护基金份额持有人利益，依据《上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金合同》约定和相关法律法规的规定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，上投摩根基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定自2013年3月12日起对上投摩根分红添利债券型型证券投资基金(以下简称"本基金")的赎回费率进行调整。详情如下：

(一)原赎回费率

A类基金份额：

持有基金份额期限	费率
小于一年	0.1%
大于等于一年小于两年	0.05%
大于等于两年	0%

B类基金份额：

持有基金份额期限	费率
小于三十天	0.1%
大于等于三十天	0%

(二)调整后的赎回费率

A类基金份额：

持有基金份额期限	费率
小于七天	1.5%
大于等于七天小于一年	0.1%
大于等于一年小于两年	0.05%
大于等于两年	0%

B类基金份额：

持有基金份额期限	费率
小于七天	1.5%
大于等于七天小于三十天	0.1%
大于等于三十天	0%

根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，对持有期少于7日的投资人收取的赎回费100%全额计入基金资产。

（三）重要提示

1、本基金赎回的其他业务规则不变。基金转换费率在适用上述调整后赎回费率的基础上，按照本公司《上投摩根基金管理有限公司基金转换业务规则》的相关规定执行。

2、投资者可登录本公司网站 (错误！超链接引用无效。 889 4888)获取相关信息。

特此公告。

上投摩根基金管理有限公司
2013年3月5日

证券代码：000887　　证券简称：中鼎股份　　公告编号：2013-03
证券代码：125887　　证券简称：中鼎转债

安徽中鼎密封件股份有限公司
关于2012年度利润分配预案的预披露公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

安徽中鼎密封件股份有限公司（以下简称"公司"）董事会于2013年3月4日收到公司董事长、控股股东、实际控制人夏鼎湖先生提交的关于公司2012年度利润分配预案的提议及承诺。为了充分保护广大投资者利益，现将预案具体内容公告如下：

1、为回报全体股东，让所有股东尤其是中小股东分享公司经营成果，提议公司2012年度利润分配方案为：以截止2012年12月31日公司股份总数595,777,562股为基数，向全体股东按每10股派发现金股利人民币1.6元（含税），合计派发现金股利95,324,409.92元；同时以未分配利润向股东每10股送8股，合计送股本476,622,050股，本次送股完成后公司总股本将变更为1,072,399,612股，剩余未分配利润结转以后年度分配。

2、公司董事长、控股股东、实际控制人夏鼎湖先生承诺，在公司董事会和股东大会审议上述利润分配相关议案时，投赞成票。

公司董事会接到夏鼎湖先生提交的关于公司2012年度利润分配预案的提议后，公司董事会成员夏鼎湖、马小鹏、夏迎松、严江威、孙昌兴、马有海、胡迁林对上述预案进行了讨论，并达成一致意见：夏鼎湖先生提交的2012年度利润分配预案符合公司实际情况，不会造成公司流动资金短缺或其他不良影响，该预案符合相关法律、法规以及公司章程的规定，具备合法性、合规性、合理性。上述董事同意将该提案提交公司最近一期董事会审议。

本预案披露前，公司严格控制内幕信息知情人的范围，并对相关内幕信息知情人履行了保密和严禁内幕交易的告知义务。

本次利润分配预案仅为公司股东做出的提议，尚未提交公司董事会及股东大会 审议。公司2012年度利润分配方案最终以董事会审议通过后，提交股东大会批准通 过为准。敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

安徽中鼎密封件股份有限公司
董 事 会
2013年03月05日

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金关于投资中小企业私募债券的公告

新华基金管理有限公司旗下新华纯债添利债券型发起式证券投资基金依据《基金部通知【2012】21号关于证券投资基金投资中小企业私募债券有关问题的通知》及相关公告文件依法投资了浙江森禾园艺有限公司发行的中小企业私募债券（债券名称：浙江森禾园艺有限公司2012年中小企业私募债券(第一期)，简称"12森园01"）。

投资信息公告如下：

基金名称	债券名称	数量（张）	期限（年）	收益率（票面利率%）
新华纯债添利债券型发起式证券投资基金	浙江森禾园艺有限公司2012年中小企业私募债券(第一期)	100000	2+1年	9.98%

特此公告。

新华基金管理有限公司
2013年3月5日

证券代码：002465　　证券简称：海格通信　　公告编号：2013-012号

广州海格通信集团股份有限公司关于被认定为2011-2012年度国家规划布局内重点软件企业的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据国家发展和改革委员会、工业和信息化部、财政部、商务部和国家税务总局等五部委联合下发的《关于认定2011-2012年度国家规划布局内重点软件企业和集成电路设计企业的通知》，广州海格通信集团股份有限公司（以下简称"公司"或"本公司"）被认定为"2011-2012年度国家规划布局内重点企业"。本公司自2002年起已连续十一年被认定为国家规划布局内重点软件企业。

根据《财政部国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税【2008】1号）关于"国家规划布局内重点软件企业当年未享受低于10%的税率优惠的，减按10%的税率征收企业所得税"的规定，公司2011、2012年度企业所得税税率将减按10%征收，公司将尽快向当地税务部门申请落实上述税收优惠政策。

特此公告。

广州海格通信集团股份有限公司董事会
2013年3月4日

证券代码：000915　　证券简称：山大华特　　公告编号：2013-006

山东山大华特科技股份有限公司子公司重大事项公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

公司子公司山东华特知新材料有限公司日前接国家科技术部于2013年2月1日下发的"关于863计划新材料领域晶体材料和高性能激光引擎技术研究主题项目立项的通知"（国科发高[2013]58号），山东华特知新材料有限公司作为项目牵头单位的"十二五"国家高技术研究发展计划（863计划）新材料技术领域"高性能激光引擎关键材料与器件工程化技术研发"主题项目的立项工作已经完成。该项目编号为2013AA030501，执行年限为3年，"863计划"专项经费为1030万元。

目前，该项目尚处于研发阶段，对公司近期的业绩不会产生直接影响。

特此公告

山东山大华特科技股份有限公司
董事会
二〇一三年三月四日

证券代码：600565　　证券简称：迪马股份　　公告编号：临2013-010号

重庆市迪马实业股份有限公司关于控股股东名称变更的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。

近日，公司接控股股东重庆东银实业（集团）有限公司（以下简称"东银集团"）的通知：东银集团名称由"重庆东银实业（集团）有限公司"更名为"重庆东银控股集团有限公司"；其经营范围由"从事建筑相关业务（凭资质证书执业），企业管理咨询服务，销售摩托车配件、汽车配件、机电产品、建筑装饰材料（不含危险化学品）、钢材、家用电器、日用百货"相应增加"从事投资业务（不含金融及财政信用业务）"业务。

上述变更事宜相关工商变更登记手续已于2013年2月26日在重庆市工商行政管理局办理完毕，并取得《准予变更登记通知书》及新《企业法人营业执照》。

特此公告。

重庆市迪马实业股份有限公司
董事会
二〇一三年三月四日