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)

(2016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: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%。

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2016年5月5日,有关财务数据截止日为2016年3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:尹维忠

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

赵玉彪先生:董事长,博士,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、总经理,现任天治基金管理有限公司董事长,天治资产管理有限公司董事长、天治资产管理有限公司投资决策委员会成员。

吕文龙先生:董事,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。

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。

常永涛先生:董事,总经理,学士,历任四川省信托投资公司上海证券总部副总经理、大成基金管理公司交易员、基金经理助理、基金经理、申万巴黎基金管理公司基金经理、投资部总经理,2009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。

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,现任上海市申达律师事务所法定代表人及首席合伙人。

王明文先生: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(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)。

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、吉林省欧化市林业局局长、吉林省欧化市市长,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。

尹维忠先生:职工监事,经济学硕士,2005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总经理助理兼监察稽核部总监。

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。

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、天治资产管理有限公司风险控制委员会成员。

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8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,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,2015年2月17日起任天治研究驱动混合型证券投资基金的基金经理。

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

2015年10月9日,投资决策委员会成员调整为:公司总经理兼投资总监常永涛先生,权益投资部总监兼天治核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金经理许家涵先生,研究发展部总监、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金兼天治成长精选混合型证券投资基金的基金经理尹维国,固定收益部总监、天治稳健双盈债券型证券投资基金、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金兼天治可转债增强债券型证券投资基金的基金经理王洋。

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:刘士余

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:林葛

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:赵玉彪

电话:021-60371155

传真:021-60374934

联系人:王珊珊、韩涵

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

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)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:蒋超良

传真:010-85109219

联系人:熊奎

客户服务电话:95599

网址: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

(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(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

(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

(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

(6)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

(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)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

(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:陈有安

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

(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

(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

(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

(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

(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:宫少林

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

(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:袁长清(代行)

联系人:刘晨

客户服务电话:10108998、4008888788

网址: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:上海市浦东民生路1199弄证大?五道口广场1号楼20层

法定代表人:兰荣

电话:0591-38507679

联系人:雷宇钦

客户服务电话:95562、4008888123

网址: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

(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

(21)齐鲁证券有限公司

住所:山东省济南市经七路86号

办公地址:山东省济南市经七路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

(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: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

传真:0755-82400826

联系人:郑舒丽

客户服务电话:95511-8

网址: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

(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

(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: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

(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

(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

(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:李黎

客户服务电话:95578

网址: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

(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

(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18-19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

传真:021-50498825

联系人:王一彦

客户服务电话:95531、4008888588

网址: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:孙巳

客户服务电话:4006989898

网址: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.glsc.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

(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

(40)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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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 万丽城品座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.stockrn.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

(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)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

(52)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

(53)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

(54)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

(55)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/

(56)杭州数米基金销售有限公司

住所:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

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:陈柏青

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

(57)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

(58)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

(59)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

(60)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

(61)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:廖萌莎

客户服务电话:4006-877-899

网址:www.tenyuanfund.com

(62)深圳众禄金融控股股份有限公司

住所:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8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;www.jjmmw.com

(63)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:北京市朝阳区光马桥路甲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

(64)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/

(二)注册登记机构

名称:天治基金管理有限公司

办公地址:上海市徐汇区复兴西路159号

法定代表人:赵玉彪

电话:021-60374960

传真:021-60374974

联系人:黄宇星

(三)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)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号东方广场东方经贸城安永大楼(东三办公楼)16层

办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼

执行事务合伙人:毛敏宁

电话:(021)22288888

传真:(021)22280000

联系人:濮晓达

经办会计师:郑杭翔、濮晓达

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%。

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2016年3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	86,408,957.88	12.01
	其中:股票	86,408,957.88	12.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	551,675,124.06	76.66
	其中:债券	551,675,124.06	76.66
	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	30,000,265.00	4.17
	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	15,146,079.93	2.10
8	其他资产	36,396,904.53	5.06
9	合计	719,627,331.40	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	73,032,957.88	11.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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