

天治稳健双盈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06月12日 送出日期：2024年06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	天治稳健双盈债券	基金代码	350006
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
基金合同生效日	2008年11月05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	契约型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
许家涵	2022年01月18日		2005年07月01日

二、基金投资与净值表现

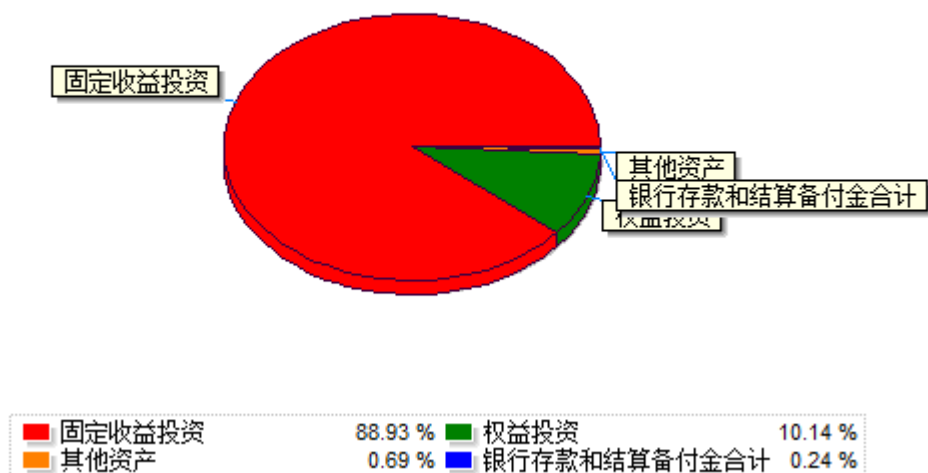
(一) 投资目标与投资策略

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。
投资范围	<p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、债券回购、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、货币市场工具、资产支持证券、国债期货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的相关规定）。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。</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，有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。</p>
主要投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。本基金将主要投资于债券资产，同时密

	<p>切关注股票市场的运行状况与风险收益特征，把握相对确定性的投资机会，从而达到股票、债券双盈的目标。债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。本基金将采取“自下而上”的方式精选个股。本基金将全面考察上市公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本面特征，同时综合利用市盈率（P/E）、市净率（P/B）和折现现金流（DCF）等估值方法对公司的投资价值进行分析和比较，挖掘具备中长期持续增长的上市公司股票库，以获得较高投资回报。</p>
业绩比较基准	中证全债指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
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。

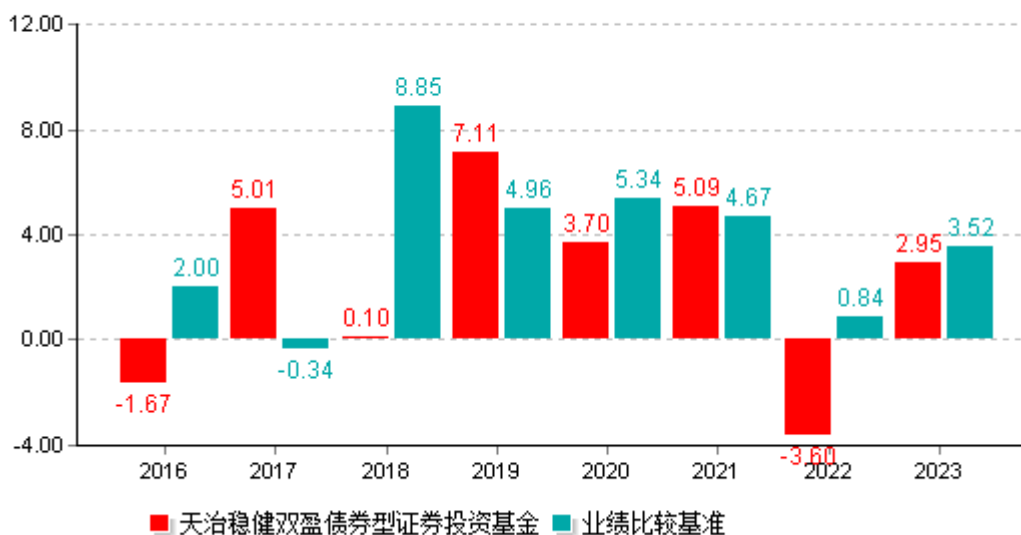
（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2023年12月31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
单位%



注：基金的过往业绩不代表未来表现。

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
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<60天	0.10%	
	N≥60天	0.00%	

申购费：本基金不收取申购费。

(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	0.70%	基金管理人和销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
销售服务费	0.30%	销售机构
审计费用	35,000.00	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）
持有期	1.31%

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（包含一旦启动侧袋机制而产生的部分份额不能赎回等影响，详情见招募说明书“侧袋机制”部分及“风险揭示”部分）、技术风险、其他风险、本基金特有的风险。

本基金的特定风险：本基金属于债券型基金，将维持较高的债券持仓比例。如果债券市场出现整体下跌，本基金的净值表现将受到影响。此外，由于本基金积极参与一级市场新股申购，如遇新股申购收益率为负，本基金将可能面临新股申购的损失；本基金保留了在股票市场系统性风险较低且整体动态估值水平合理的约束条件下适度参与股票二级市场投资的选择权，如果本基金对股票市场系统性风险和市场整体动态估值水平的判断出现较大偏差，将可能面临股票二级市场投资的损失。本基金将严格执行新股申购因素分析和股票二级市场投资的约束条件，力争将以上风险控制在最小范围之内，以实现本基金稳健收益的累积效应。本基金可投资资产支持证券，主要存在以下风险：1) 特定原始权益人破产风险、现金流预测风险等与基础资产相关的风险；2) 资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、评级风险等与资产支持证券相关的风险；3) 管理人违约违规风险、托管人违约违规风险、专项计划账户管理风险、资产服务机构违规风险等与专项计划管理相关的风险；4) 政策风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险等其他风险。本基金可投资国债期货，主要存在以下风险：本基金投资国债期货，国债期货交易采用保证金交易方式，基金资产可能由于无法及时筹措资金满足建立或者维持国债期货头寸所要求的保证金而面临保证金风险。

（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。