

天治基金管理有限公司关于旗下九只基金就参与存托凭证投资事宜

修订相关法律文件的公告

根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》的有关规定及各基金基金合同的约定，天治基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与各基金的基金托管人协商一致，就旗下九只基金参与存托凭证投资事宜对相关法律文件进行修订，现将相关修订情况说明如下：

一、修订基金范围

序号 基金名称

- 1 天治财富增长证券投资基金
- 2 天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金
- 3 天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）
- 4 天治量化核心精选混合型证券投资基金
- 5 天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金
- 6 天治新消费灵活配置混合型证券投资基金
- 7 天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金
- 8 天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金
- 9 天治转型升级混合型证券投资基金

二、基金合同、托管协议及招募说明书（更新）修订

本次基金合同修订内容包括明确投资范围包含存托凭证，增加存托凭证的风险揭示、投资策略、投资限制、估值方法及信息披露等约定，托管协议、招募说明书、产品资料概要涉及相关内容的一并进行了修订，并对招募说明书进行了信息更新。

（一）以天治新消费灵活配置混合型证券投资基金为例，基金合同修订内容具体如下：

1、“第一部分前言”增加本基金投资存托凭证的相关风险揭示：

“八、本基金的投资范围包括存托凭证，如果投资，可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业发行人、境外发行人、存托凭证发行机制和交易机制等相关的风险。”

2、“第十二部分基金的投资”的“投资范围”部分增加了存托凭证，投资范围修改为：

“本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、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）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金股票及存托凭证资产投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于受益于新消费主题相关企业的证券不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”

3、“第十二部分基金的投资”的“投资策略”部分增加存托凭证投资策略，描述如下：

“7.存托凭证投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。”

4、“第十二部分基金的投资”的“投资限制”部分增加存托凭证投资限制，描述如下：

“四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票及存托凭证资产投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于受益于新消费主题相关企业的证券不低于非现金基金资产的 80%；

.....

（20）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；”

5、“第十四部分基金资产估值”的“估值对象”部分增加存托凭证，描述如下：

“基金所拥有的股票、存托凭证、股指期货合约、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。”

6、“第十四部分基金资产估值”的“估值方法”部分增加存托凭证估值方法，描述如下：

“7、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。”

7、“第十四部分基金资产估值”的“特殊情况的处理”部分因上述修订导致的序号变化顺序调整，描述如下：

“1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。”

（二）招募说明书（更新）的“重要提示”及“风险揭示”部分增加投资于存托凭证的风险，揭示如下：

“本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。”

二、重要提示

1、本次九只基金基金合同、托管协议和招募说明书修订的内容和程序符合相关法律法规的规定及基金合同的约定，上述基金合同、托管协议的修订事宜自 2020 年 12 月 10 日起生效。基金管理人将于本公告发布当日，将修订后的基金合同、托管协议、招募说明书（更新）、产品资料概要（更新）等法律文件登载于基金管理人网站

（www.chinanature.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）。

2、投资者欲了解有关上述基金及相关业务的详细情况，请登录基金管理人网站认真查阅相关基金合同、最新的招募说明书和相关公告，或拨打基金管理人客户服务电话（400-098-4800）查询。

风险提示：

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责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将来表现。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资者在投资基金之前，请仔细阅读基金的产品资料概要、招募说明书和基金合同，全面认识基金的风险收益特征和产品特

性，并充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。本公告的解释权归本公司所有。

特此公告。

天治基金管理有限公司

2020年12月10日