

天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：天治基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况（转型前）.....	5
2.1 基金基本情况（转型后）.....	5
2.2 基金产品说明（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	9
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现（转型前）.....	10
3.2 基金净值表现（转型后）.....	11
3.3 其他指标.....	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	17
6.1 资产负债表(转型前).....	17
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	38
6.1 资产负债表（转型后）.....	38
6.2 利润表.....	39
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	40
6.4 报表附注.....	40
§7 投资组合报告(转型前)	57
7.1 期末基金资产组合情况.....	57
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	58
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	67
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	67
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	68
§7 投资组合报告(转型后)	69
7.1 期末基金资产组合情况	69
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	69
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后)	70
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	80
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	80
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	80
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	80
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	81
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	81
7.12 投资组合报告附注	81
§8 基金份额持有人信息(转型前)	82
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
8.2 期末上市基金前十名持有人	82
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	83
§8 基金份额持有人信息(转型后)	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
8.2 期末上市基金前十名持有人	83
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	83
§9 开放式基金份额变动	84
§10 重大事件揭示	84
10.1 基金份额持有人大会决议	84
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	84
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
10.4 基金投资策略的改变	85
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	85
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)	87
10.8 其他重大事件 (转型后)	88
10.8 其他重大事件 (转型前)	90

§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	93
§12 备查文件目录.....	93
12.1 备查文件目录.....	93
12.2 存放地点.....	93
12.3 查阅方式.....	93

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	天治品质优选混合型证券投资基金
基金简称	天治品质优选
场内简称	-
基金主代码	350002
交易代码	350002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年1月12日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	74,404,343.09份
基金合同存续期（若有）	不定期
基金份额上市的证券交易所（若有）	-
上市日期（若有）	-

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	天治低碳经济混合
场内简称	-
基金主代码	350002
交易代码	350002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月18日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	44,146,266.75份
基金合同存续期（若有）	不定期
基金份额上市的证券交易所（若有）	-
上市日期（若有）	-

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	在有效控制风险的前提下，追求中长期稳定且超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金以股票品种为主要投资标的，以自下而上的股票优选策略为主，辅以自上而下的类别资产配置、行业资产配置，通过综合运用财务品质、经营品质和市场品质三大评估体系，优选具有长期发展潜力的上市公司股票进行投资，并在投资运作的各个环节实施全面风险预算管理。
业绩比较基准（若有）	沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。
风险收益特征（若有）	本基金属于证券投资基金中风险水平适中的品种，在投资管理全过程中严格实施风险预算管理，在明确的风险预算目标范围内追求稳定的超额收益率。

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	在灵活配置股票和债券资产的基础上，精选受益于低碳经济的主题相关企业，追求持续稳健的超额回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>资产配置策略方面，本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据宏观经济运行态势、政策变化、市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>本基金实施大类资产配置策略过程中还将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，动态优化投资组合，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>在全球气候变暖的背景下，以低能耗、低污染为基础的“低碳经济”成为全球热点。低碳经济是一种以低能耗、低污染、低排放为特点的发展模式，是以应对气候变化、保障能源安全、促进经济社会可持续发展有机结合为目的的新规则。本基金将沿着低碳经济的路线，把握其中蕴含的投资机会。</p> <p>（1）低碳经济主题类股票的界定：</p> <p>本基金认可的低碳经济主题类股票包括两种类型的股票：</p> <p>1) 直接从事低碳经济主题相关行业的股票</p> <p>①清洁能源：主要包括清洁能源的研发、生产与运营，如风能、太阳能、生物质能、水电及核电等；也包括清洁能源的传输、服务等配套产业，如特高压输电、智能电网等相关上市公司；</p>

②节能减排：主要包括与节能技术和装备、节能产品及节能服务产业的相关上市公司，如工业节能、建筑节能、汽车节能；也包括化石能源减排，如清洁燃煤、整体煤气化联合循环、碳捕获与封存等相关上市公司；

③碳交易与陆地碳汇、海洋碳汇：主要包括与清洁发展机制项目和农林产业减排增汇等相关的上市公司；

④环保行业：包括环保技术和设备、环保服务和资源利用等相关行业的上市公司；

2) 受益于低碳经济主题的股票，包括：

①传统高耗能高污染行业中，通过有效节能减排措施或污染治理措施，实现能耗降低、污染改善，从而实现产业升级，相对同类公司受益的上市公司；

②与低碳经济主题相关的服务行业

③投资于低碳经济相关产业的上市公司；

④因与低碳经济主题相关的产业结构升级、消费生活模式转变而受益的其他上市公司。

未来，由于经济增长方式转变、产业结构升级等因素，从事或受益于上述投资主题的外延将会逐渐扩大，本基金将视实际情况调整上述对低碳环保主题类股票的识别及认定。

(2) 个股投资策略

通过行业领先度和市场领先度的双重定量评价以及长期驱动因素和事件驱动因素的双重定性分析，精选受益于低碳经济主题相关企业进行重点投资。

行业领先度主要考察盈利能力、行业贡献度和主营业务显著度，其中以盈利能力为主。盈利能力通过净资产收益率和毛利率并辅以经营性现金流量和自由现金流量进行综合评估，行业贡献度依据营业收入和营业利润在行业中占比进行衡量，主营业务显著度通过主营行业或产品的营业收入占比和营业利润占比进行比较。

市场领先度主要考察估值水平、流动性和机构认同度，其中以估值水平为主。估值水平通过 PE、PS、PB、净利润增长率、营业收入增长率、PEG、PSG 等静态估值水平、动态估值水平、历史成长性、预期成长性指标以及综合估值水平与成长性的指标进行横向和纵向比较，流动性指标包括自由流通比例和日均换手率、日均交易额等交易活跃度指标，机构认同度是指外部研究机构对个股的成长性与价值的一致性预期。

长期驱动因素主要考察主营业务前景、管理层能力、公司战略和治理结构。以上因素作为公司内生性成长的基础，是公司可持续性发展的保障。

事件驱动因素主要考察公司是否存在兼并收购、投资项目、资产增值等基本面的正向变动。以上因素是公司外延式增长的体现，作为长期驱动因素分析的有效补充。

3、债券投资策略

	<p>在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向、发行人情况和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术选择个券，选择被价格低估的债券进行投资。</p> <p>本基金投资于中小企业私募债。由于中小企业私募债券整体流动性相对较差，且整体信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值或期限套利等操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>
业绩比较基准（若有）	中证内地低碳经济主题指数收益率×50%+中证全债指

	数收益率×50%。
风险收益特征（若有）	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天治基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	尹维忠	罗菲菲
	联系电话	021-60374975	010-58560666
	电子邮箱	yinwz@chinanature.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-098-4800（免长途通话费用）、 021-34064800	95568
传真		021-60374934	010-58560798
注册地址		上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		上海市复兴西路 159 号	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		200031	100031
法定代表人		赵玉彪	洪崎

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.chinanature.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天治基金管理有限公司	上海市复兴西路 159 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日-2016年6月30日)	
	转型前	转型后
本期已实现收益	-7,219,795.31	-1,113,689.79
本期利润	-9,077,320.77	-1,768,902.02
加权平均基金份额本期利润	-0.1838	-0.0398

本期加权平均净值利润率	-22.81%	-5.21%
本期基金份额净值增长率	-20.96%	-3.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
期末可供分配利润	-14,412,180.60	-10,320,560.57
期末可供分配基金份额利润	-0.1937	-0.2338
期末基金资产净值	59,992,162.49	33,825,706.18
期末基金份额净值	0.8063	0.7662
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	185.61%	-3.46%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

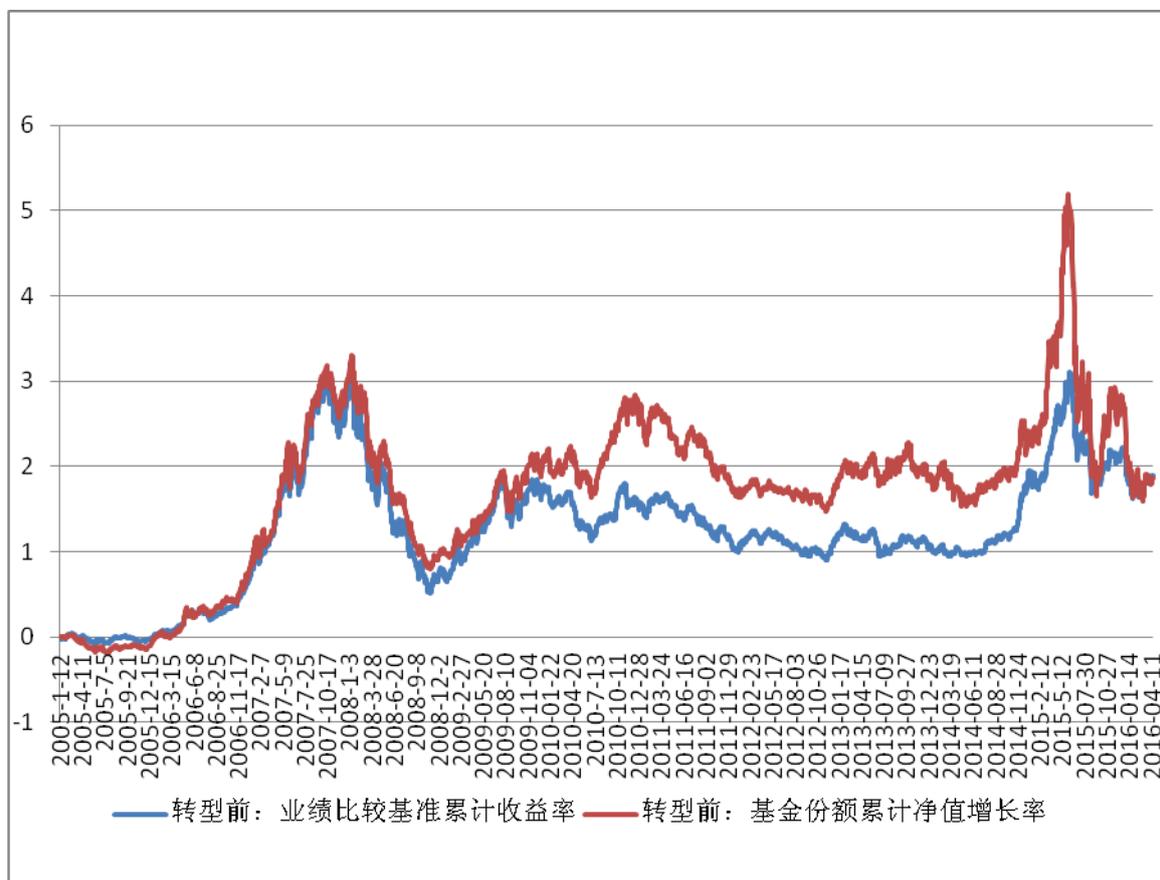
3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	转型前					
	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	6.68%	1.49%	4.68%	0.81%	2.00%	0.68%
过去三个月	-3.89%	2.18%	1.43%	1.34%	-5.32%	0.84%
过去六个月	-11.46%	2.49%	-1.33%	1.41%	-10.13%	1.08%
过去一年	-36.65%	3.13%	-16.59%	1.89%	-20.06%	1.24%
过去三年	-1.14%	2.21%	34.99%	1.38%	-36.13%	0.83%
自基金合同生效起至今	185.61%	1.67%	188.95%	1.45%	-3.34%	0.22%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



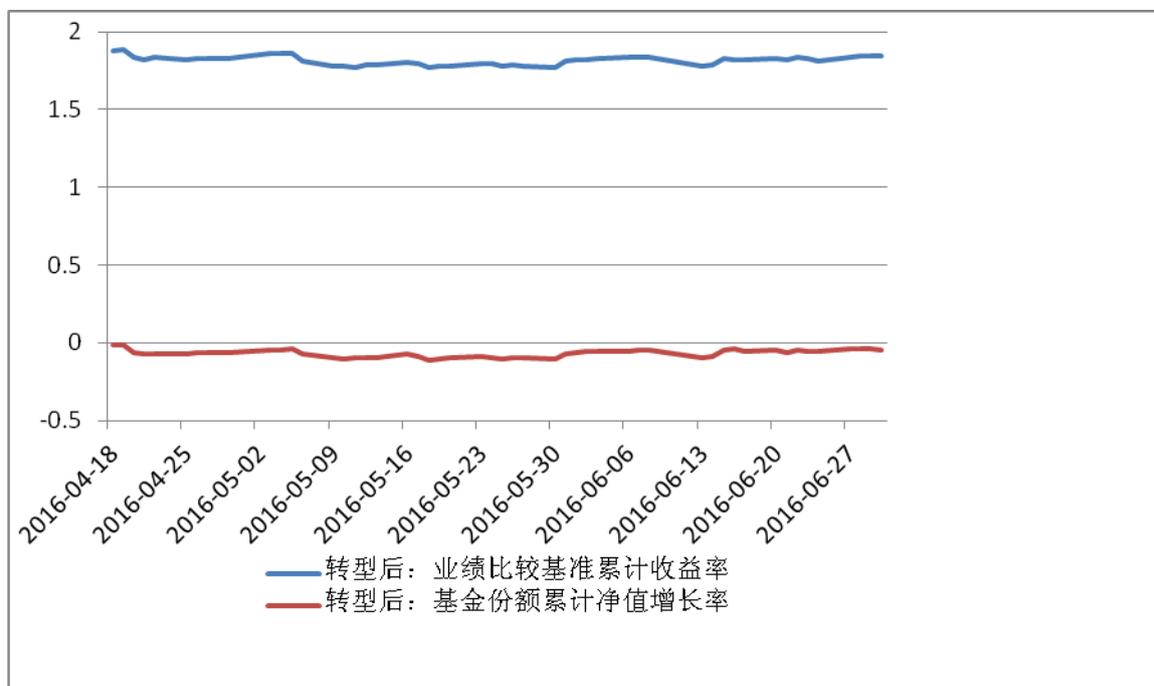
3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

转型后						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2016-4-18 至 2016-6-30	-3.46%	1.79%	-0.94%	0.67%	-2.52%	1.12%

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

注：无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人——天治基金管理有限公司于 2003 年 5 月成立，注册资本 1.6 亿元，注册地为上海。公司股权结构为：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%。截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下共有十只开放式基金，除本基金外，另外九只基金——天治稳健双盈债券型证券投资基金、天治财富增长证券投资基金、天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）、天治天得利货币市场基金、天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金（转型自 2008 年 5 月 8 日生效的天治创新先锋混合型证券投资基金）、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、天治成长精

选混合型证券投资基金、天治可转债增强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的基金合同（转型自 2011 年 12 月 28 日生效的天治稳定收益债券型证券投资基金）分别于 2008 年 11 月 5 日、2004 年 6 月 29 日、2006 年 1 月 20 日、2006 年 7 月 5 日、2016 年 4 月 7 日、2009 年 7 月 15 日、2011 年 8 月 4 日、2013 年 6 月 4 日、2015 年 6 月 9 日生效。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾海	本基金基金经理	2015 年 6 月 12 日	-	7	2001 年 7 月至 2005 年 8 月就职于上海丝绸（集团）股份有限公司，2005 年 9 月至 2006 年 8 月就职于皮尔磁工业自动化贸易（上海）有限公司，2008 年 7 月至 2009 年 2 月就职于交银国际控股有限公司任研究员，2009 年 3 月至 2011 年 2 月就职于国联证券股份有限公司任研究员，2011 年 3 月至 2013 年 6 月就职于光大保德信基金管理有限公司任研究员，2013 年 9 月至今就职于天治基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理。

注：1、表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾海	本基金基金经理	2015 年 6 月 12 日	-	7	2001 年 7 月至 2005 年 8 月就职于上海丝绸（集团）股份有限公司，2005 年 9 月至 2006 年 8 月就职于皮尔磁工业自动化贸易（上海）有限公司，2008 年 7

					月至 2009 年 2 月就职于交银国际控股有限公司任研究员, 2009 年 3 月至 2011 年 2 月就职于国联证券股份有限公司任研究员, 2011 年 3 月至 2013 年 6 月就职于光大保德信基金管理有限公司任研究员, 2013 年 9 月至今就职于天治基金管理有限公司, 历任行业研究员、基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

注：1、表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》、《天治品质优选混合型证券投资基金招募说明书》、转型后《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的约定, 本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产, 为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度, 加强内部管理, 规范基金运作。本报告期内, 基金运作合法合规, 没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内, 本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司《公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》。本基金管理人公平交易体系涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节, 并通过明确投资权限划分、建立统一研究报告管理平台、分层次建立适用全公司及各投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库、应用投资管理系统公平交易相关程序、定期对不同投资组合收益率差异、交易价差、成交量事后量化分析评估等一系列措施切实落实各项公平交易制度。

报告期内, 本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好, 未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易的情形，未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

报告期内，本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场总体呈“L”型走势，主要是由于一月份市场暴跌导致开局不利，三大指数普遍跌幅超过 20%。待情绪平稳之后，市场在供给侧改革、超额信贷数据，全球宽松预期等因素的刺激下，风险偏好有所回升，指数呈震荡回升的格局，结构性机会明显。上半年市场热点板块众多，其中上半年最具代表性的热点板块包括食品饮料、黄金、新能源汽车、芯片国产化、次新股等。

本基金一月初的配置以成长股为主，并且维持了较高的仓位运作，因此一月份的回撤较大，基于控制风险的考虑，本基金进行了适度的减仓，并积极参与周期股的反弹。本基金在四月份进行了产品转型，强化了行业、主题投资策略，将投资范围聚焦在受益于低碳经济的相关主题，由于产品转型期间仓位波动较大，且市场相对疲软，基金净值出现较大幅度的回撤。二季度中后期，本基金加强了与低碳相关主题的配置，特别是新能源汽车产业链、锂电池材料、智能汽车等板块的配置，净值取得一定的回升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末，本报告期（2016 年 4 月 18 日-2016 年 6 月 30 日），本基金份额净值为 0.7662 元，报告期内本基金份额净值增长率为-3.46%，业绩比较基准收益率为-0.94%，低于同期业绩比较基准收益率 2.52%。

截至转型前报告期末（2016 年 4 月 17 日），本基金份额净值为 0.8063 元，报告期末前六个月内，本基金份额净值增长率为-11.46%，业绩比较基准收益率为-1.33%，低于同期业绩比较基准收益率 10.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年宏观经济数据表现平稳，一、二季度 GDP 增速均达到 6.7%，分项数据除了基建相对较

好外，其他的数据均缺乏亮点，基本符合市场对经济形势的预期。展望下半年，我们预计经济继续维持“L”型的概率较大，主要是因为稳定的经济环境有利于推进供给侧改革，并且政府有望通过 PPP 模式加大推进基建投资，以对冲房地产投资可能下滑的风险。

经过上半年风险释放和预期重构，政策监管日趋完善，市场风险偏好有所回升，本基金认为下半年证券市场的机会大于风险。但由于经济形势仍处于筑底期间，且增量资金有限，因此我们预计市场将延续第二季度的“慢牛”行情。

经济转型和改革是我国政府面临的主要问题，产业结构升级是未来我国经济发展的主要方向，本基金认为代表未来国家战略发展方向的领域如“互联网+”、人工智能、新能源汽车等产业将继续引领市场主流，我们始终看好相关领域的投资机会，这是取得超额收益的重要来源。

改革是本届政府的核心任务，是中国经济转型成功的必要保障，我们预计下半年供给侧改革和国企改革将在政策支持下取得实质性的进展，预计下半年国企改革主题存在一定的投资机会。

综合上述判断，我们认为可以逐步挑选出一批具备高投资性价比的优秀标的。本基金始终关注新兴产业，并且将聚焦受益于低碳经济主题的相关标的。同时也关注有利于提升人们对生活质量追求的行业，如娱乐、体育、医疗、教育等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人的基金估值和会计核算由基金结算部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制。基金结算部人员均具备基金从业资格和会计专业工作经历。为确保基金资产估值的公平、合理、合规，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了天治基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了有关议事规则。估值委员会成员包括公司投资决策委员会成员、负责基金结算的管理层、监察稽核部总监、金融工程小组等，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对于投资管理部以及金融工程小组提交的估值模型和估值结果进行论证审核，并签署最终意见。基金经理会参与估值，与金融工程小组一同根据估值模型、估值程序计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，将估值结果提交公司估值委员会。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未分配利润。根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况，不需分配利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

转型后，本基金报告期内存在连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，出现上述情形的时间段为 2016 年 4 月 18 日至 2016 年 6 月 30 日。本基金报告期内基金份额持有人数在 200 人以上。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对天治品质优选混合型证券投资基金、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人一天治基金管理有限公司在天治品质优选混合型证券投资基金、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，天治品质优选混合型证券投资基金、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由天治品质优选混合型证券投资基金、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金管理人一天治基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前)

6.1 资产负债表(转型前)

会计主体：天治品质优选

报告截止日： 2016 年 4 月 17 日

单位：人民币元

资产	附注号	报告期初至转型前	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,437,847.43	5,988,117.96
结算备付金		943,827.65	882,026.76
存出保证金		165,645.11	175,808.96
交易性金融资产	6.4.7.2	51,640,199.98	36,670,271.00
其中：股票投资		51,640,199.98	36,670,271.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		359,129.78	2,087,910.63
应收利息	6.4.7.5	11,566.40	1,825.50
应收股利		-	-
应收申购款		6,609.75	20,439.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		61,564,826.10	45,826,400.15
负债和所有者权益	附注号	报告期初至转型前	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		370,015.73	101,459.29
应付赎回款		75,536.83	33,872.61
应付管理人报酬		41,725.16	58,994.41
应付托管费		6,954.22	9,832.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	962,354.22	575,080.07
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	116,077.45	201,414.58
负债合计		1,572,663.61	980,653.35
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	74,404,343.09	43,956,438.22
未分配利润	6.4.7.10	-14,412,180.60	889,308.58
所有者权益合计		59,992,162.49	44,845,746.80
负债和所有者权益总计		61,564,826.10	45,826,400.15

注：报告截止日 2016 年 4 月 17 日，基金份额净值 0.8063 元，基金份额总额 74,404,343.09 份。

6.2 利润表

会计主体：天治品质优选

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-8,177,766.04	29,348,586.83
1. 利息收入		51,370.57	48,916.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,347.10	48,908.74
债券利息收入		-	8.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		21,023.47	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,379,448.03	37,015,295.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,380,245.88	36,899,312.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	797.85	115,983.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,857,525.46	-7,745,992.35
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,836.88	30,366.53
减：二、费用		899,554.73	2,033,171.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	176,867.10	596,171.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	29,477.90	99,361.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	624,103.69	1,234,322.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	69,106.04	103,314.55

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,077,320.77	27,315,415.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,077,320.77	27,315,415.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治品质优选

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	43,956,438.22	889,308.58	44,845,746.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,077,320.77	-9,077,320.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	30,447,904.87	-6,224,168.41	24,223,736.46
其中：1. 基金申购款	38,444,911.69	-7,762,011.44	30,682,900.25
2. 基金赎回款	-7,997,006.82	1,537,843.03	-6,459,163.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	74,404,343.09	-14,412,180.60	59,992,162.49
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	85,832,918.52	-4,379,600.82	81,453,317.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,315,415.83	27,315,415.83
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-42,906,640.12	-12,388,599.24	-55,295,239.36
其中：1. 基金申购款	21,442,458.94	6,682,015.43	28,124,474.37

2. 基金赎回款	-64,349,099.06	-19,070,614.67	-83,419,713.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	42,926,278.40	10,547,215.77	53,473,494.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>赵玉彪</u>	<u>闫译文</u>	<u>黄宇星</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天治品质优选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2004]192 号文《关于同意天治品质优选混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由天治基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2005 年 1 月 12 日正式生效，首次设立募集规模为 1,212,569,189.32 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为天治基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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。本基金以股票品种为主要投资标的，以自下而上的股票优选策略为主，辅以自上而下的类别资产配置、行业资产配置，并依托专业的管理经验和有效的风险预算管理，构建和动态调整投资组合，以追求基金资产的中长期稳定增值。

本基金原业绩比较基准为：中信标普 300 指数×70%+中信标普国债指数×30%。自 2015 年 8 月 4 日起，本基金的业绩比较基准变更为沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关

于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 4 月 17 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与 2015 年年度报告一致。

6.4.4.1 会计年度

-

6.4.4.2 记账本位币

-

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

-

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

-

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

-

6.4.4.7 实收基金

-

6.4.4.8 损益平准金

-

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

-

6.4.4.10 费用的确认和计量

-

6.4.4.11 基金的收益分配政策

-

6.4.4.12 分部报告

-

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

-

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年4月17日
活期存款	8,437,847.43
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,437,847.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年4月17日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	51,475,803.49	51,640,199.98	164,396.49
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	51,475,803.49	51,640,199.98	164,396.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年4月17日
应收活期存款利息	9,882.63

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	905.34
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	580.01
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	198.42
合计	11,566.40

6.4.7.6 其他资产

注：无

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年4月17日
交易所市场应付交易费用	962,354.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	962,354.22

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年4月17日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	224.49
其他	6,786.92
预提费用	109,066.04
合计	116,077.45

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年4月17日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	43,956,438.22	43,956,438.22
本期申购	38,444,911.69	38,444,911.69

本期赎回（以“-”号填列）	-7,997,006.82	-7,997,006.82
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	74,404,343.09	74,404,343.09

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,501,059.47	-12,611,750.89	889,308.58
本期利润	-7,219,795.31	-1,857,525.46	-9,077,320.77
本期基金份额交易产生的变动数	4,661,693.36	-10,885,861.77	-6,224,168.41
其中：基金申购款	5,886,497.71	-13,648,509.15	-7,762,011.44
基金赎回款	-1,224,804.35	2,762,647.38	1,537,843.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,942,957.52	-25,355,138.12	-14,412,180.60

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年4月17日
活期存款利息收入	24,680.06
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,262.05
其他	1,404.99
合计	30,347.10

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年4月17日
卖出股票成交总额	199,394,324.58
减：卖出股票成本总额	205,774,570.46
买卖股票差价收入	-6,380,245.88

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年4月17日
股票投资产生的股利收益	797.85
基金投资产生的股利收益	-
合计	797.85

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年4月17日
1. 交易性金融资产	-1,857,525.46
——股票投资	-1,857,525.46
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,857,525.46

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年4月17日
基金赎回费收入	7,515.39
转换费收入	321.49
合计	7,836.88

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年4月17日
交易所市场交易费用	624,103.69
银行间市场交易费用	-
合计	624,103.69

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年4月17日
审计费用	14,753.88
信息披露费	41,312.16
账户维护费用	3,000.00
其他	10,000.00
银行汇划费用	40.00
合计	69,106.04

6.4.7.21 分部报告

-

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天治基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

注：无

6.4.10.1.2 债券交易

注：无

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

6.4.10.1.4 权证交易

注：无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年4 月17日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	176,867.10	596,171.98
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	40,788.09	142,075.84

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	29,477.90	99,361.98

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未于关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	9,234,489.16	9,234,489.16
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,234,489.16	9,234,489.16
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	12.41%	21.01%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年4月17日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	8,437,847.43	24,680.06	17,552,852.96	41,212.51

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：无

6.4.12 期末（2016年4月17日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600576	万家文化	2016年4月11日	重大事项	23.22	-	-	130,000	2,872,864.56	3,018,600.00	-
000002	万科A	2015年12月21日	重大事项	19.62	2016年7月4日	21.99	100,000	2,105,400.00	1,962,000.00	-
300038	梅泰诺	2015年12月16日	重大事项	48.63	-	-	25,000	1,334,360.00	1,215,750.00	-

600745	中茵股份	2016年1月27日	重大事项	27.71	2016年5月4日	26.70	40,000	1,047,618.00	1,108,400.00	-
--------	------	------------	------	-------	-----------	-------	--------	--------------	--------------	---

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以内部控制委员会为核心的、由督察长、内部控制委员会、监察稽核部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金

份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2016年4月17日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,437,847.43	-	-	-	-	-	8,437,847.43
结算备付金	943,827.65	-	-	-	-	-	943,827.65
存出保证金	165,645.11	-	-	-	-	-	165,645.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	51,640,199.98	51,640,199.98
应收证券清算款	-	-	-	-	-	359,129.78	359,129.78
应收利息	-	-	-	-	-	11,566.40	11,566.40
应收申购款	-	-	-	-	-	6,609.75	6,609.75
资产总计	9,547,320.19	-	-	-	-	52,017,505.91	61,564,826.10
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	370,015.73	370,015.73
应付赎回款	-	-	-	-	-	75,536.83	75,536.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41,725.16	41,725.16
应付托管费	-	-	-	-	-	6,954.22	6,954.22

应付交易费用	-	-	-	-	-	962,354.22	962,354.22
其他负债	-	-	-	-	-	116,077.45	116,077.45
负债总计	-	-	-	-	-	1,572,663.61	1,572,663.61
利率敏感度缺口	9,547,320.19	-	-	-	-	-50,444,842.30	59,992,162.49
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,988,117.96	-	-	-	-	-	5,988,117.96
结算备付金	882,026.76	-	-	-	-	-	882,026.76
存出保证金	175,808.96	-	-	-	-	-	175,808.96
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-36,670,271.00	36,670,271.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,087,910.63	2,087,910.63
应收利息	-	-	-	-	-	1,825.50	1,825.50
应收申购款	-	-	-	-	-	20,439.34	20,439.34
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,045,953.68	-	-	-	-	-38,780,446.47	45,826,400.15
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	101,459.29	101,459.29
应付赎回款	-	-	-	-	-	33,872.61	33,872.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	58,994.41	58,994.41
应付托管费	-	-	-	-	-	9,832.39	9,832.39
应付交易费用	-	-	-	-	-	575,080.07	575,080.07
其他负债	-	-	-	-	-	201,414.58	201,414.58
负债总计	-	-	-	-	-	980,653.35	980,653.35
利率敏感度缺口	7,045,953.68	-	-	-	-	-37,799,793.12	44,845,746.80

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 4 月 17 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 利率上升 25 个基点	-	-
	2. 利率下降 25 个基点	-	-

注：本报告期末本基金均未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年4月17日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	51,640,199.98	86.07	36,670,271.00	81.77
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	51,640,199.98	86.07	36,670,271.00	81.77

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年4月17日）	上年度末（2015年12月31日）
	1. 业绩比较基准变动 5%	2,653,827.00	3,045,324.83
2. 业绩比较基准变动-5%	-2,653,827.00	-3,045,324.83	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

-

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后)

6.1 资产负债表（转型后）

会计主体：天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	转型后至报告期末
资产：		
银行存款	6.4.7.1	5,648,066.21
结算备付金		624,158.73
存出保证金		173,837.08
交易性金融资产	6.4.7.2	27,285,138.00
其中：股票投资		27,285,138.00
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		1,551,768.06
应收利息	6.4.7.5	1,518.11
应收股利		-
应收申购款		5,190.22
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		35,289,676.41
负债和所有者权益	附注号	转型后至报告期末
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		90,506.10
应付管理人报酬		41,519.13
应付托管费		6,919.86
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	1,223,415.54
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	101,609.60
负债合计		1,463,970.23
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	44,146,266.75
未分配利润	6.4.7.10	-10,320,560.57
所有者权益合计		33,825,706.18
负债和所有者权益总计		35,289,676.41

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7662 元，基金份额总额 44,146,266.75 份。

6.2 利润表

会计主体：天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 4 月 18 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2016 年 4 月 18 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-1,132,414.19
1. 利息收入		14,515.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,515.38
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-523,239.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-650,537.28
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	127,297.76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-655,212.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	31,522.18
减：二、费用		636,487.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	102,343.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,057.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	440,095.99
5. 利息支出		-

其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	76,990.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,768,902.02
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,768,902.02

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 4 月 18 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 18 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	74,404,343.09	-14,412,180.60	59,992,162.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,768,902.02	-1,768,902.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	-30,258,076.34	5,860,522.05	-24,397,554.29
其中：1. 基金申购款	1,293,180.74	-323,795.45	969,385.29
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-31,551,257.08	6,184,317.50	-25,366,939.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	44,146,266.75	-10,320,560.57	33,825,706.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵玉彪

基金管理人负责人

闫译文

主管会计工作负责人

黄宇星

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金由天治品质优选混合型证券投资基金通过转型变

更而来。

天治品质优选混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准天治品质优选混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2004】192 号文）核准募集，基金管理人为天治基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

天治品质优选混合型证券投资基金自 2004 年 11 月 29 日至 2005 年 1 月 7 日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》于 2005 年 1 月 12 日生效。

2016 年 4 月 18 日，天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会以【通讯】方式召开，大会讨论通过了天治品质优选混合型证券投资基金的转型议案，内容包括天治品质优选混合型证券投资基金调整投资目标、投资范围、投资策略、基金费用、收益分配方式、估值方法以及修订基金合同等，并更名为“天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金”。本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

自 2016 年 4 月 18 日起，《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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）、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：本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于受益于低碳经济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。

本基金的业绩比较基准为：中证内地低碳经济主题指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，

同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与 2015 年年度报告一致。

6.4.4.1 会计年度

-

6.4.4.2 记账本位币

-

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

-

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

-

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

-

6.4.4.7 实收基金

-

6.4.4.8 损益平准金

-

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

-

6.4.4.10 费用的确认和计量

-

6.4.4.11 基金的收益分配政策

-

6.4.4.12 分部报告

-

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

-

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转

让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	5,648,066.21
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,648,066.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	27,775,953.74	27,285,138.00	-490,815.74
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	27,775,953.74	27,285,138.00	-490,815.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产或负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,194.85
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	252.81
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.07
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	70.38
合计	1,518.11

6.4.7.6 其他资产

注：无

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,223,415.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,223,415.54

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	341.02
其他	6,786.92
预提费用	94,481.66
合计	101,609.60

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年4月18日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	74,404,343.09	74,404,343.09
- 基金份额折算调整	-	-
- 未领取红利份额折算调整(若有)	-	-
- 集中申购募集资金本金及利息	-	-
- 基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	1,293,180.74	1,293,180.74
本期赎回(以“-”号填列)	-31,551,257.08	-31,551,257.08
本期末	44,146,266.75	44,146,266.75

6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	11,138,768.65	-25,550,949.25	-14,412,180.60
本期利润	-1,113,689.79	-655,212.23	-1,768,902.02
本期基金份额交易产生的变动数	-4,437,443.59	10,297,965.64	5,860,522.05
其中：基金申购款	141,442.89	-465,238.34	-323,795.45
基金赎回款	-4,578,886.48	10,763,203.98	6,184,317.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,587,635.27	-15,908,195.84	-10,320,560.57

6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2016年4月18日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,633.83
其他	564.46
合计	14,515.38

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月18日至2016年6月30日
	卖出股票成交总额

减：卖出股票成本总额	154,443,661.70
买卖股票差价收入	-650,537.28

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：无

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年4月18日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	127,297.76
基金投资产生的股利收益	-
合计	127,297.76

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年4月18日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-655,212.23
——股票投资	-655,212.23
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-655,212.23

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年4月18日至2016年6月30日
基金赎回费收入	31,510.82
转换费收入	11.36
合计	31,522.18

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年4月18日至2016年6月30日

交易所市场交易费用	440,095.99
银行间市场交易费用	-
合计	440,095.99

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月18日至2016年6月30日
审计费用	10,109.14
信息披露费	28,306.48
账户维护费用	-1,500.00
其他	40,050.00
银行汇划费用	25.00
合计	76,990.62

6.4.7.21 分部报告

-

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天治基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

注：无

6.4.10.1.2 债券交易

注：无

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

6.4.10.1.4 权证交易

注：无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月18日至2016年6月30日
当期应支付的管理费	102,343.90
其中：支付销售机构的客户维护费	26,200.79

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月18日至2016年6月30日
当期应支付的托管费	17,057.32

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未于关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2016 年 4 月 18 日至 2016 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	9,234,489.16
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分增加的份额	-
期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	9,234,489.16
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	20.92%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2016 年 4 月 18 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	5,648,066.21	11,317.09

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：无

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600576	万家文化	2016年4月11日	重大事项	21.80	-	-	130,000	2,872,864.56	2,834,000.00	-
000002	万科A	2015年12月21日	重大事项	18.20	2016年7月4日	21.99	100,000	2,105,400.00	1,820,000.00	-
002355	兴民钢圈	2016年5月12日	重大事项	21.09	-	-	50,000	950,000.00	1,054,500.00	-
300038	梅泰诺	2015年12月16日	重大事项	50.58	-	-	25,000	1,334,360.00	1,264,500.00	-
300323	华灿光电	2016年4月18日	重大事项	9.35	-	-	200,000	1,657,000.00	1,870,000.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以内部控制委员会为核心的、由督察长、内部控制委员会、监察稽核部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一

般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,648,066.21	-	-	-	-	-	5,648,066.21
结算备付金	624,158.73	-	-	-	-	-	624,158.73
存出保证金	173,837.08	-	-	-	-	-	173,837.08
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-27,285,138.00	27,285,138.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,551,768.06	1,551,768.06
应收利息	-	-	-	-	-	1,518.11	1,518.11
应收申购款	-	-	-	-	-	5,190.22	5,190.22
资产总计	6,446,062.02	-	-	-	-	-28,843,614.39	35,289,676.41
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	90,506.10	90,506.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41,519.13	41,519.13
应付托管费	-	-	-	-	-	6,919.86	6,919.86
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,223,415.54	1,223,415.54
其他负债	-	-	-	-	-	101,609.60	101,609.60
负债总计	-	-	-	-	-	1,463,970.23	1,463,970.23
利率敏感度缺口	6,446,062.02	-	-	-	-	-27,379,644.16	33,825,706.18

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2016年6月30日）
	1. 利率上升 25 个基点	-
	2. 利率下降 25 个基点	-

注：本报告期末本基金均未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	27,285,138.00	80.66
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	27,285,138.00	80.66

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2016年6月30日）
	1. 业绩比较基准变动 5%	1,472,178.38
	2. 业绩比较基准变动-5%	-1,472,178.38

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

-

§ 7 投资组合报告(转型前)

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	51,640,199.98	83.88
	其中：股票	51,640,199.98	83.88
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,381,675.08	15.24
7	其他资产	542,951.04	0.88
8	合计	61,564,826.10	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	23,792,050.00	39.66
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	3,018,600.00	5.03

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	12,567,136.84	20.95
J	金融业	3,973,423.14	6.62
K	房地产业	4,710,240.00	7.85
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	3,578,750.00	5.97
S	综合	-	-
	合计	51,640,199.98	86.07

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002730	电光科技	80,000	3,564,000.00	5.94
2	600576	万家文化	130,000	3,018,600.00	5.03
3	300073	当升科技	70,000	2,422,700.00	4.04
4	300059	东方财富	50,000	2,264,500.00	3.77
5	601688	华泰证券	119,946	2,169,823.14	3.62
6	300168	万达信息	70,000	1,969,800.00	3.28
7	000002	万科A	100,000	1,962,000.00	3.27
8	002590	万安科技	70,000	1,894,200.00	3.16
9	300196	长海股份	50,000	1,850,000.00	3.08
10	600837	海通证券	120,000	1,803,600.00	3.01
11	300323	华灿光电	200,000	1,798,000.00	3.00
12	300133	华策影视	65,000	1,790,750.00	2.98
13	600633	浙报传媒	100,000	1,788,000.00	2.98
14	002624	完美环球	45,000	1,767,600.00	2.95
15	000971	高升控股	60,000	1,734,000.00	2.89

16	300271	华宇软件	85,000	1,728,900.00	2.88
17	300232	洲明科技	50,000	1,714,500.00	2.86
18	300287	飞利信	119,978	1,653,296.84	2.76
19	601799	星宇股份	45,000	1,643,400.00	2.74
20	601028	玉龙股份	200,000	1,638,000.00	2.73
21	600158	中体产业	80,000	1,620,800.00	2.70
22	002311	海大集团	100,000	1,616,000.00	2.69
23	300010	立思辰	61,400	1,449,040.00	2.42
24	002548	金新农	80,000	1,396,800.00	2.33
25	601012	隆基股份	100,000	1,330,000.00	2.22
26	300038	梅泰诺	25,000	1,215,750.00	2.03
27	600730	中国高科	68,000	1,127,440.00	1.88
28	600745	中茵股份	40,000	1,108,400.00	1.85
29	600271	航天信息	10,000	600,300.00	1.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300271	华宇软件	4,874,258.53	10.87
2	600576	万家文化	4,401,450.00	9.81
3	300168	万达信息	4,209,616.00	9.39
4	300059	东方财富	3,843,551.00	8.57
5	300010	立思辰	3,578,800.00	7.98
6	600048	保利地产	3,531,300.00	7.87
7	002730	电光科技	3,495,650.64	7.79
8	002329	皇氏集团	3,272,371.80	7.30
9	600489	中金黄金	3,069,100.00	6.84
10	000978	桂林旅游	2,845,684.10	6.35
11	002308	威创股份	2,834,500.00	6.32
12	300291	华录百纳	2,809,627.80	6.27
13	002590	万安科技	2,765,000.00	6.17
14	601028	玉龙股份	2,720,081.00	6.07
15	600958	东方证券	2,640,597.93	5.89
16	601799	星宇股份	2,631,787.00	5.87

17	600754	锦江股份	2,609,500.00	5.82
18	300073	当升科技	2,593,300.00	5.78
19	000060	中金岭南	2,479,000.00	5.53
20	300144	宋城演艺	2,455,432.00	5.48
21	002280	联络互动	2,343,704.00	5.23
22	002074	国轩高科	2,281,355.00	5.09
23	600497	驰宏锌锗	2,204,354.00	4.92
24	601688	华泰证券	2,116,203.58	4.72
25	300166	东方国信	2,088,172.00	4.66
26	300037	新宙邦	2,079,383.60	4.64
27	300332	天壕环境	2,079,335.00	4.64
28	600352	浙江龙盛	2,063,200.00	4.60
29	002001	新和成	2,032,775.00	4.53
30	000709	河钢股份	1,999,574.00	4.46
31	300031	宝通科技	1,990,443.00	4.44
32	002460	赣锋锂业	1,965,584.00	4.38
33	300047	天源迪科	1,957,500.00	4.36
34	300367	东方网力	1,885,750.00	4.20
35	300136	信维通信	1,849,379.55	4.12
36	600837	海通证券	1,817,467.00	4.05
37	300274	阳光电源	1,800,500.00	4.01
38	300133	华策影视	1,786,308.00	3.98
39	300232	洲明科技	1,782,623.00	3.98
40	300196	长海股份	1,770,000.00	3.95
41	300198	纳川股份	1,763,500.00	3.93
42	002777	久远银海	1,759,500.00	3.92
43	600633	浙报传媒	1,729,394.00	3.86
44	002624	完美世界	1,721,008.00	3.84
45	002311	海大集团	1,711,606.00	3.82
46	000971	高升控股	1,671,000.00	3.73
47	300287	飞利信	1,666,374.30	3.72
48	300323	华灿光电	1,657,000.00	3.69
49	601336	新华保险	1,640,000.00	3.66
50	600804	鹏博士	1,577,000.00	3.52
51	600158	中体产业	1,569,620.00	3.50
52	600030	中信证券	1,559,600.00	3.48

53	600399	抚顺特钢	1,558,500.00	3.48
54	600136	当代明诚	1,555,047.00	3.47
55	300001	特锐德	1,511,460.00	3.37
56	600019	宝钢股份	1,483,200.00	3.31
57	002241	歌尔股份	1,474,000.00	3.29
58	600531	豫光金铅	1,460,847.17	3.26
59	002548	金新农	1,411,100.00	3.15
60	600366	宁波韵升	1,401,285.00	3.12
61	002292	奥飞娱乐	1,392,000.00	3.10
62	300352	北信源	1,379,928.20	3.08
63	600699	均胜电子	1,332,000.00	2.97
64	300190	维尔利	1,320,758.15	2.95
65	601777	力帆股份	1,246,497.04	2.78
66	600562	国睿科技	1,239,700.00	2.76
67	600547	山东黄金	1,209,500.00	2.70
68	600177	雅戈尔	1,195,600.00	2.67
69	600662	强生控股	1,186,500.00	2.65
70	600519	贵州茅台	1,175,000.00	2.62
71	300224	正海磁材	1,159,105.30	2.58
72	002501	利源精制	1,146,500.00	2.56
73	600114	东睦股份	1,134,000.00	2.53
74	600884	杉杉股份	1,132,000.00	2.52
75	600340	华夏幸福	1,118,919.00	2.50
76	000671	阳光城	1,114,262.00	2.48
77	000878	云南铜业	1,113,300.00	2.48
78	002605	姚记扑克	1,105,559.00	2.47
79	002019	亿帆鑫富	1,104,900.00	2.46
80	300148	天舟文化	1,104,500.00	2.46
81	600589	广东榕泰	1,101,789.00	2.46
82	300033	同花顺	1,099,600.00	2.45
83	002123	荣信股份	1,093,526.87	2.44
84	000530	大冷股份	1,080,440.00	2.41
85	002413	雷科防务	1,078,444.00	2.40
86	002395	双象股份	1,077,253.00	2.40
87	002224	三力士	1,072,570.84	2.39
88	002429	兆驰股份	1,070,650.00	2.39

89	300100	双林股份	1,069,252.00	2.38
90	600730	中国高科	1,068,075.88	2.38
91	002467	二六三	1,067,080.00	2.38
92	300498	温氏股份	1,065,890.68	2.38
93	300339	润和软件	1,064,300.00	2.37
94	002446	盛路通信	1,064,135.00	2.37
95	002007	华兰生物	1,062,350.00	2.37
96	603008	喜临门	1,061,968.52	2.37
97	002262	恩华药业	1,060,159.99	2.36
98	600501	航天晨光	1,048,833.00	2.34
99	600745	中茵股份	1,047,618.00	2.34
100	002146	荣盛发展	1,047,500.00	2.34
101	002244	滨江集团	1,047,000.00	2.33
102	601198	东兴证券	1,042,000.00	2.32
103	002303	美盈森	1,041,543.00	2.32
104	000959	首钢股份	1,039,000.00	2.32
105	300253	卫宁健康	1,037,022.00	2.31
106	000558	莱茵体育	1,035,821.00	2.31
107	300262	巴安水务	1,029,000.00	2.29
108	300178	腾邦国际	1,025,543.83	2.29
109	300383	光环新网	1,024,940.00	2.29
110	600172	黄河旋风	1,022,265.00	2.28
111	002431	棕榈股份	1,014,200.00	2.26
112	000807	云铝股份	1,008,440.00	2.25
113	002092	中泰化学	999,323.00	2.23
114	300014	亿纬锂能	994,200.00	2.22
115	002699	美盛文化	993,000.00	2.21
116	002488	金固股份	991,800.00	2.21
117	300182	捷成股份	990,000.00	2.21
118	002245	澳洋顺昌	990,000.00	2.21
119	300251	光线传媒	990,000.00	2.21
120	000895	双汇发展	989,750.00	2.21
121	002271	东方雨虹	989,200.00	2.21
122	600303	曙光股份	989,100.00	2.21
123	002155	湖南黄金	986,188.00	2.20
124	600622	嘉宝集团	984,750.00	2.20

125	600386	北巴传媒	979,967.00	2.19
126	002247	帝龙新材	978,000.00	2.18
127	000716	黑芝麻	976,819.00	2.18
128	300199	翰宇药业	972,500.00	2.17
129	002443	金洲管道	971,900.20	2.17
130	300008	天海防务	971,315.00	2.17
131	600988	赤峰黄金	969,600.00	2.16
132	002285	世联行	963,000.00	2.15
133	600688	上海石化	951,446.00	2.12
134	002355	兴民智通	950,000.00	2.12
135	601699	潞安环能	935,934.00	2.09
136	600111	北方稀土	935,700.00	2.09
137	601555	东吴证券	934,400.00	2.08
138	002615	哈尔斯	932,000.00	2.08
139	002325	洪涛股份	929,789.00	2.07
140	002407	多氟多	928,484.50	2.07
141	300324	旋极信息	926,492.00	2.07
142	002167	东方锆业	920,000.00	2.05
143	300302	同有科技	916,000.00	2.04
144	600157	永泰能源	916,000.00	2.04

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300168	万达信息	3,858,485.00	8.60
2	600048	保利地产	3,551,756.05	7.92
3	600489	中金黄金	3,171,626.97	7.07
4	002329	皇氏集团	3,073,565.95	6.85
5	300271	华宇软件	2,993,110.70	6.67
6	300291	华录百纳	2,985,172.00	6.66
7	000978	桂林旅游	2,833,563.00	6.32
8	002308	威创股份	2,722,015.15	6.07
9	002280	联络互动	2,623,500.00	5.85
10	300010	立思辰	2,580,600.00	5.75
11	600754	锦江股份	2,479,300.00	5.53

12	300144	宋城演艺	2,433,089.00	5.43
13	600958	东方证券	2,427,079.01	5.41
14	300031	宝通科技	2,328,761.00	5.19
15	600497	驰宏锌锗	2,218,209.00	4.95
16	300047	天源迪科	2,203,585.00	4.91
17	000060	中金岭南	2,137,592.25	4.77
18	000558	莱茵体育	2,134,422.28	4.76
19	300332	天壕环境	2,107,064.00	4.70
20	300166	东方国信	2,069,600.00	4.61
21	002123	荣信股份	2,060,513.00	4.59
22	002001	新和成	2,051,700.00	4.58
23	002466	天齐锂业	2,021,518.00	4.51
24	600352	浙江龙盛	1,998,796.70	4.46
25	300136	信维通信	1,995,825.00	4.45
26	002395	双象股份	1,963,864.00	4.38
27	002460	赣锋锂业	1,949,806.00	4.35
28	300450	先导智能	1,848,707.00	4.12
29	300198	纳川股份	1,830,000.00	4.08
30	000709	河钢股份	1,820,590.15	4.06
31	300059	东方财富	1,756,178.00	3.92
32	300274	阳光电源	1,725,916.50	3.85
33	600804	鹏博士	1,648,118.06	3.68
34	002777	久远银海	1,633,838.00	3.64
35	600136	当代明诚	1,579,741.50	3.52
36	002241	歌尔股份	1,572,101.00	3.51
37	600030	中信证券	1,565,000.00	3.49
38	601336	新华保险	1,560,000.00	3.48
39	600576	万家文化	1,486,466.68	3.31
40	600019	宝钢股份	1,475,000.00	3.29
41	600699	均胜电子	1,459,000.00	3.25
42	300001	特锐德	1,443,000.00	3.22
43	600531	豫光金铅	1,425,000.00	3.18
44	300352	北信源	1,419,302.00	3.16
45	002292	奥飞娱乐	1,365,039.90	3.04
46	600547	山东黄金	1,328,356.00	2.96
47	002407	多氟多	1,319,234.00	2.94
48	002074	国轩高科	1,288,000.00	2.87
49	600399	抚顺特钢	1,274,000.00	2.84

50	002717	岭南园林	1,273,800.00	2.84
51	002019	亿帆鑫富	1,263,810.00	2.82
52	600366	宁波韵升	1,263,500.00	2.82
53	600562	国睿科技	1,240,608.00	2.77
54	000793	华闻传媒	1,240,529.00	2.77
55	300190	维尔利	1,234,311.22	2.75
56	603008	喜临门	1,225,727.44	2.73
57	603588	高能环境	1,224,000.00	2.73
58	300324	旋极信息	1,217,349.00	2.71
59	300207	欣旺达	1,206,350.00	2.69
60	600177	雅戈尔	1,200,000.00	2.68
61	300037	新宙邦	1,184,000.00	2.64
62	601777	力帆股份	1,170,000.00	2.61
63	600519	贵州茅台	1,152,526.00	2.57
64	600884	杉杉股份	1,140,200.00	2.54
65	002183	怡亚通	1,124,300.00	2.51
66	300262	巴安水务	1,104,000.00	2.46
67	600988	赤峰黄金	1,098,900.00	2.45
68	002590	万安科技	1,095,286.00	2.44
69	603308	应流股份	1,092,739.00	2.44
70	300078	思创医惠	1,089,204.00	2.43
71	300251	光线传媒	1,089,150.00	2.43
72	002429	兆驰股份	1,087,500.00	2.42
73	002431	棕榈股份	1,085,425.00	2.42
74	002224	三力士	1,077,204.00	2.40
75	002325	洪涛股份	1,077,000.00	2.40
76	600593	大连圣亚	1,070,250.00	2.39
77	601198	东兴证券	1,068,500.00	2.38
78	002501	利源精制	1,058,502.90	2.36
79	300253	卫宁健康	1,050,000.00	2.34
80	600501	航天晨光	1,043,500.00	2.33
81	600688	上海石化	1,041,100.00	2.32
82	000878	云南铜业	1,036,800.00	2.31
83	600340	华夏幸福	1,034,420.00	2.31
84	000807	云铝股份	1,031,900.00	2.30
85	300148	天舟文化	1,028,857.00	2.29
86	300367	东方网力	1,028,850.00	2.29
87	600662	强生控股	1,027,801.00	2.29

88	300498	温氏股份	1,020,400.00	2.28
89	300339	润和软件	1,014,711.30	2.26
90	300302	同有科技	1,010,000.00	2.25
91	002285	世联行	1,008,803.00	2.25
92	002271	东方雨虹	1,008,461.00	2.25
93	601028	玉龙股份	1,008,428.00	2.25
94	300100	双林股份	1,006,500.00	2.24
95	600622	嘉宝集团	1,001,070.00	2.23
96	300008	天海防务	1,000,890.00	2.23
97	000895	双汇发展	1,000,000.00	2.23
98	000671	阳光城	1,000,000.00	2.23
99	300182	捷成股份	991,144.00	2.21
100	002303	美盈森	990,500.00	2.21
101	002169	智光电气	989,606.00	2.21
102	002007	华兰生物	989,049.00	2.21
103	000530	大冷股份	986,795.00	2.20
104	000716	黑芝麻	982,327.00	2.19
105	300033	同花顺	979,573.00	2.18
106	600303	曙光股份	974,433.00	2.17
107	300014	亿纬锂能	974,080.00	2.17
108	002146	荣盛发展	965,716.00	2.15
109	002092	中泰化学	962,565.00	2.15
110	600172	黄河旋风	962,000.00	2.15
111	002413	雷科防务	955,617.00	2.13
112	300199	翰宇药业	948,200.00	2.11
113	300224	正海磁材	945,143.00	2.11
114	002244	滨江集团	942,000.00	2.10
115	002467	二六三	927,500.00	2.07
116	002605	姚记扑克	927,400.00	2.07
117	002446	盛路通信	927,210.00	2.07
118	601799	星宇股份	921,000.00	2.05
119	000971	高升控股	914,662.00	2.04
120	002155	湖南黄金	913,051.00	2.04
121	000959	首钢股份	911,644.00	2.03
122	002443	金洲管道	911,400.00	2.03
123	600114	东睦股份	904,335.00	2.02
124	002699	美盛文化	897,200.00	2.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	222,602,024.90
卖出股票收入（成交）总额	199,394,324.58

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：无

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：无

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

注：无

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：无

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	165,645.11
2	应收证券清算款	359,129.78
3	应收股利	-
4	应收利息	11,566.40
5	应收申购款	6,609.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	542,951.04

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600576	万家文化	3,018,600.00	5.03	重大事项
2	000002	万科A	1,962,000.00	3.27	重大事项

7.12.6 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。

§ 7 投资组合报告(转型后)

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	27,285,138.00	77.32
	其中：股票	27,285,138.00	77.32
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,272,224.94	17.77
7	其他资产	1,732,313.47	4.91
8	合计	35,289,676.41	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	17,337,578.00	51.26
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	2,834,000.00	8.38
G	交通运输、仓储和邮政业	925,800.00	2.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	839,200.00	2.48
J	金融业	2,529,360.00	7.48
K	房地产业	1,820,000.00	5.38
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	999,200.00	2.95
S	综合	-	-
	合计	27,285,138.00	80.66

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后)

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600576	万家文化	130,000	2,834,000.00	8.38
2	300323	华灿光电	200,000	1,870,000.00	5.53
3	000002	万科 A	100,000	1,820,000.00	5.38
4	300038	梅泰诺	25,000	1,264,500.00	3.74
5	601689	拓普集团	35,000	1,153,250.00	3.41
6	600418	江淮汽车	90,000	1,141,200.00	3.37
7	300100	双林股份	25,000	1,095,250.00	3.24
8	002418	康盛股份	100,000	1,056,000.00	3.12
9	002355	兴民钢圈	50,000	1,054,500.00	3.12
10	600884	杉杉股份	60,000	1,032,600.00	3.05
11	300336	新文化	40,000	999,200.00	2.95
12	002335	科华恒盛	20,000	970,400.00	2.87
13	300373	扬杰科技	40,000	964,400.00	2.85
14	600198	大唐电信	48,000	954,240.00	2.82
15	002673	西部证券	36,000	930,960.00	2.75
16	000783	长江证券	80,000	928,000.00	2.74
17	002357	富临运业	60,000	925,800.00	2.74
18	002176	江特电机	60,000	924,000.00	2.73
19	300207	欣旺达	35,000	898,450.00	2.66
20	300458	全志科技	8,000	855,840.00	2.53
21	300010	立思辰	40,000	839,200.00	2.48
22	002329	皇氏集团	50,000	749,500.00	2.22
23	300446	乐凯新材	15,000	738,000.00	2.18
24	000776	广发证券	40,000	670,400.00	1.98

25	002537	海立美达	20,245	615,448.00	1.82
----	--------	------	--------	------------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300010	立思辰	5,578,800.00	16.49
2	300271	华宇软件	5,179,058.53	15.31
3	300059	东方财富	5,006,023.00	14.80
4	600884	杉杉股份	4,781,319.10	14.14
5	600576	万家文化	4,401,450.00	13.01
6	300168	万达信息	4,209,616.00	12.45
7	002329	皇氏集团	4,022,371.80	11.89
8	600366	宁波韵升	3,859,911.00	11.41
9	300073	当升科技	3,824,800.00	11.31
10	600489	中金黄金	3,769,300.00	11.14
11	601799	星宇股份	3,610,067.00	10.67
12	600048	保利地产	3,531,300.00	10.44
13	002730	电光科技	3,495,650.64	10.33
14	600699	均胜电子	3,384,000.00	10.00
15	300224	正海磁材	3,319,647.30	9.81
16	002460	赣锋锂业	3,318,173.00	9.81
17	002108	沧州明珠	2,943,430.00	8.70
18	000978	桂林旅游	2,845,684.10	8.41
19	002308	威创股份	2,834,500.00	8.38
20	300291	华录百纳	2,809,627.80	8.31
21	002590	万安科技	2,765,000.00	8.17
22	300232	洲明科技	2,746,189.00	8.12
23	300136	信维通信	2,744,379.55	8.11
24	601028	玉龙股份	2,720,081.00	8.04
25	300133	华策影视	2,705,508.00	8.00
26	002311	海大集团	2,676,407.40	7.91
27	600958	东方证券	2,640,597.93	7.81
28	600754	锦江股份	2,609,500.00	7.71

29	600136	当代明诚	2,529,047.00	7.48
30	002241	歌尔股份	2,510,000.00	7.42
31	000060	中金岭南	2,479,000.00	7.33
32	300144	宋城演艺	2,455,432.00	7.26
33	600547	山东黄金	2,399,500.00	7.09
34	002280	联络互动	2,343,704.00	6.93
35	002074	国轩高科	2,281,355.00	6.74
36	601777	力帆股份	2,247,997.04	6.65
37	300100	双林股份	2,243,902.00	6.63
38	600497	驰宏锌锗	2,204,354.00	6.52
39	300367	东方网力	2,162,750.00	6.39
40	300324	旋极信息	2,156,492.00	6.38
41	601688	华泰证券	2,116,203.58	6.26
42	300166	东方国信	2,088,172.00	6.17
43	300037	新宙邦	2,079,383.60	6.15
44	300332	天壕环境	2,079,335.00	6.15
45	600352	浙江龙盛	2,063,200.00	6.10
46	002262	恩华药业	2,040,089.99	6.03
47	002001	新和成	2,032,775.00	6.01
48	002340	格林美	2,028,463.00	6.00
49	000558	莱茵体育	2,019,321.00	5.97
50	000709	河钢股份	1,999,574.00	5.91
51	300031	宝通科技	1,990,443.00	5.88
52	002245	澳洋顺昌	1,980,000.00	5.85
53	000050	深天马 A	1,978,511.00	5.85
54	300383	光环新网	1,962,731.20	5.80
55	300047	天源迪科	1,957,500.00	5.79
56	300033	同花顺	1,919,550.00	5.67
57	300287	飞利信	1,894,374.30	5.60
58	002155	湖南黄金	1,885,688.00	5.57
59	600887	伊利股份	1,867,659.00	5.52
60	600837	海通证券	1,817,467.00	5.37
61	300274	阳光电源	1,800,500.00	5.32
62	002165	红宝丽	1,797,500.00	5.31
63	300196	长海股份	1,770,000.00	5.23
64	300198	纳川股份	1,763,500.00	5.21

65	002777	久远银海	1,759,500.00	5.20
66	600303	曙光股份	1,748,985.00	5.17
67	600633	浙报传媒	1,729,394.00	5.11
68	002624	完美世界	1,721,008.00	5.09
69	002358	森源电气	1,714,500.00	5.07
70	000971	高升控股	1,671,000.00	4.94
71	300253	卫宁健康	1,669,662.00	4.94
72	300323	华灿光电	1,657,000.00	4.90
73	603686	龙马环卫	1,651,000.00	4.88
74	601336	新华保险	1,640,000.00	4.85
75	600804	鹏博士	1,577,000.00	4.66
76	600158	中体产业	1,569,620.00	4.64
77	600030	中信证券	1,559,600.00	4.61
78	600399	抚顺特钢	1,558,500.00	4.61
79	300001	特锐德	1,511,460.00	4.47
80	600019	宝钢股份	1,483,200.00	4.38
81	300207	欣旺达	1,481,450.00	4.38
82	600531	豫光金铅	1,460,847.17	4.32
83	002335	科华恒盛	1,455,997.00	4.30
84	002548	金新农	1,411,100.00	4.17
85	002292	奥飞娱乐	1,392,000.00	4.12
86	000858	五粮液	1,387,950.00	4.10
87	300352	北信源	1,379,928.20	4.08
88	601186	中国铁建	1,369,416.00	4.05
89	300190	维尔利	1,320,758.15	3.90
90	600562	国睿科技	1,239,700.00	3.66
91	002664	信质电机	1,204,699.00	3.56
92	600177	雅戈尔	1,195,600.00	3.53
93	600418	江淮汽车	1,194,000.00	3.53
94	600662	强生控股	1,186,500.00	3.51
95	600199	金种子酒	1,182,000.00	3.49
96	600519	贵州茅台	1,175,000.00	3.47
97	002501	利源精制	1,146,500.00	3.39
98	600114	东睦股份	1,134,000.00	3.35
99	600340	华夏幸福	1,118,919.00	3.31
100	000671	阳光城	1,114,262.00	3.29

101	000878	云南铜业	1,113,300.00	3.29
102	002605	姚记扑克	1,105,559.00	3.27
103	002019	亿帆鑫富	1,104,900.00	3.27
104	300148	天舟文化	1,104,500.00	3.27
105	600589	广东榕泰	1,101,789.00	3.26
106	002256	彩虹精化	1,098,960.00	3.25
107	002123	荣信股份	1,093,526.87	3.23
108	000530	大冷股份	1,080,440.00	3.19
109	002413	雷科防务	1,078,444.00	3.19
110	002395	双象股份	1,077,253.00	3.18
111	002224	三力士	1,072,570.84	3.17
112	002429	兆驰股份	1,070,650.00	3.17
113	600730	中国高科	1,068,075.88	3.16
114	002467	二六三	1,067,080.00	3.15
115	300498	温氏股份	1,065,890.68	3.15
116	002418	康盛股份	1,065,490.00	3.15
117	300339	润和软件	1,064,300.00	3.15
118	002446	盛路通信	1,064,135.00	3.15
119	300017	网宿科技	1,063,425.00	3.14
120	002007	华兰生物	1,062,350.00	3.14
121	603008	喜临门	1,061,968.52	3.14
122	600501	航天晨光	1,048,833.00	3.10
123	600745	中茵股份	1,047,618.00	3.10
124	002146	荣盛发展	1,047,500.00	3.10
125	002244	滨江集团	1,047,000.00	3.10
126	601198	东兴证券	1,042,000.00	3.08
127	002303	美盈森	1,041,543.00	3.08
128	000959	首钢股份	1,039,000.00	3.07
129	300262	巴安水务	1,029,000.00	3.04
130	300178	腾邦国际	1,025,543.83	3.03
131	600172	黄河旋风	1,022,265.00	3.02
132	300078	思创医惠	1,020,100.00	3.02
133	000333	美的集团	1,018,315.00	3.01
134	002431	棕榈股份	1,014,200.00	3.00
135	000807	云铝股份	1,008,440.00	2.98
136	300336	新文化	1,006,800.00	2.98

137	002357	富临运业	1,004,000.00	2.97
138	300068	南都电源	999,680.00	2.96
139	002092	中泰化学	999,323.00	2.95
140	300373	扬杰科技	995,078.00	2.94
141	300014	亿纬锂能	994,200.00	2.94
142	600198	大唐电信	993,220.00	2.94
143	002699	美盛文化	993,000.00	2.94
144	002488	金固股份	991,800.00	2.93
145	300251	光线传媒	990,000.00	2.93
146	300182	捷成股份	990,000.00	2.93
147	000876	新希望	990,000.00	2.93
148	000895	双汇发展	989,750.00	2.93
149	002271	东方雨虹	989,200.00	2.92
150	300127	银河磁体	987,250.00	2.92
151	600622	嘉宝集团	984,750.00	2.91
152	300077	国民技术	984,672.00	2.91
153	300346	南大光电	983,520.00	2.91
154	002455	百川股份	981,200.00	2.90
155	600386	北巴传媒	979,967.00	2.90
156	002247	帝龙新材	978,000.00	2.89
157	000716	黑芝麻	976,819.00	2.89
158	601689	拓普集团	976,426.00	2.89
159	002229	鸿博股份	975,600.00	2.88
160	300199	翰宇药业	972,500.00	2.88
161	002546	新联电子	972,000.00	2.87
162	002443	金洲管道	971,900.20	2.87
163	300008	天海防务	971,315.00	2.87
164	600729	重庆百货	969,707.00	2.87
165	600988	赤峰黄金	969,600.00	2.87
166	000970	中科三环	968,500.00	2.86
167	603609	禾丰牧业	965,450.00	2.85
168	600446	金证股份	964,450.00	2.85
169	002285	世联行	963,000.00	2.85
170	002341	新纶科技	960,000.00	2.84
171	600702	沱牌舍得	957,906.00	2.83
172	002448	中原内配	956,757.60	2.83

173	601069	西部黄金	954,400.00	2.82
174	600688	上海石化	951,446.00	2.81
175	002355	兴民智通	950,000.00	2.81
176	002249	大洋电机	949,070.94	2.81
177	002273	水晶光电	946,004.71	2.80
178	002508	老板电器	941,400.00	2.78
179	600667	太极实业	941,000.00	2.78
180	000783	长江证券	939,093.00	2.78
181	601699	潞安环能	935,934.00	2.77
182	600111	北方稀土	935,700.00	2.77
183	601555	东吴证券	934,400.00	2.76
184	002673	西部证券	932,400.00	2.76
185	002615	哈尔斯	932,000.00	2.76
186	300458	全志科技	930,400.00	2.75
187	002325	洪涛股份	929,789.00	2.75
188	600597	光明乳业	929,559.90	2.75
189	002407	多氟多	928,484.50	2.74
190	002385	大北农	928,000.00	2.74
191	002176	江特电机	924,000.00	2.73
192	000538	云南白药	920,421.50	2.72
193	002167	东方锆业	920,000.00	2.72
194	300302	同有科技	916,000.00	2.71
195	600157	永泰能源	916,000.00	2.71
196	000860	顺鑫农业	913,611.00	2.70
197	300027	华谊兄弟	904,050.00	2.67
198	600521	华海药业	900,000.00	2.66
199	000988	华工科技	892,500.00	2.64
200	002618	丹邦科技	887,000.00	2.62
201	000418	小天鹅 A	886,500.00	2.62
202	002739	万达院线	876,500.00	2.59
203	002169	智光电气	872,000.00	2.58
204	000758	中色股份	859,499.00	2.54
205	002157	正邦科技	847,536.00	2.51
206	300252	金信诺	836,987.00	2.47
207	600273	嘉化能源	835,000.00	2.47
208	300097	智云股份	828,000.00	2.45

209	002707	众信旅游	814,000.00	2.41
210	300377	赢时胜	811,000.00	2.40
211	600392	盛和资源	810,000.00	2.39
212	600707	彩虹股份	796,600.00	2.36
213	600029	南方航空	780,000.00	2.31
214	300365	恒华科技	780,000.00	2.31
215	300389	艾比森	778,500.00	2.30
216	300446	乐凯新材	773,850.00	2.29
217	002466	天齐锂业	737,400.00	2.18
218	600115	东方航空	734,860.00	2.17
219	000960	锡业股份	690,000.00	2.04
220	603999	读者传媒	690,000.00	2.04
221	300048	合康变频	680,700.00	2.01
222	000776	广发证券	677,033.00	2.00

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300073	当升科技	3,934,310.05	11.63
2	300059	东方财富	3,180,000.00	9.40
3	002730	电光科技	3,152,725.20	9.32
4	002108	沧州明珠	2,983,528.00	8.82
5	601799	星宇股份	2,738,014.00	8.09
6	300232	洲明科技	2,608,190.20	7.71
7	300133	华策影视	2,590,000.00	7.66
8	300010	立思辰	2,570,322.00	7.60
9	600366	宁波韵升	2,465,073.00	7.29
10	002311	海大集团	2,413,769.45	7.14
11	600884	杉杉股份	2,366,955.50	7.00
12	300324	旋极信息	2,313,807.96	6.84
13	300224	正海磁材	2,254,705.00	6.67
14	002340	格林美	2,195,597.00	6.49
15	002245	澳洋顺昌	2,170,918.00	6.42
16	601688	华泰证券	2,144,785.56	6.34
17	600699	均胜电子	2,138,772.00	6.32

18	000050	深天马 A	2,047,760.00	6.05
19	002590	万安科技	1,952,943.00	5.77
20	300168	万达信息	1,898,562.00	5.61
21	300271	华宇软件	1,881,550.00	5.56
22	600837	海通证券	1,800,000.00	5.32
23	600887	伊利股份	1,795,330.00	5.31
24	002165	红宝丽	1,792,240.00	5.30
25	300196	长海股份	1,770,000.00	5.23
26	002624	完美世界	1,738,828.00	5.14
27	600633	浙报传媒	1,718,000.00	5.08
28	002358	森源电气	1,696,406.12	5.02
29	000971	高升控股	1,677,752.00	4.96
30	600158	中体产业	1,662,000.00	4.91
31	603686	龙马环卫	1,654,788.00	4.89
32	002548	金新农	1,618,713.00	4.79
33	300287	飞利信	1,599,626.98	4.73
34	601028	玉龙股份	1,536,023.00	4.54
35	002256	彩虹精化	1,404,000.00	4.15
36	002664	信质电机	1,338,245.00	3.96
37	000858	五粮液	1,296,084.00	3.83
38	002460	赣锋锂业	1,293,746.00	3.82
39	600547	山东黄金	1,241,750.00	3.67
40	300127	银河磁体	1,210,200.00	3.58
41	601012	隆基股份	1,210,000.00	3.58
42	600386	北巴传媒	1,146,612.50	3.39
43	300346	南大光电	1,142,302.00	3.38
44	002074	国轩高科	1,138,361.00	3.37
45	600199	金种子酒	1,101,856.00	3.26
46	300367	东方网力	1,097,350.00	3.24
47	300068	南都电源	1,085,600.00	3.21
48	600729	重庆百货	1,039,650.00	3.07
49	002407	多氟多	1,036,140.00	3.06
50	300017	网宿科技	1,029,260.00	3.04
51	600745	中茵股份	1,024,047.00	3.03
52	600730	中国高科	1,023,400.00	3.03
53	603609	禾丰牧业	1,016,766.00	3.01
54	002241	歌尔股份	1,015,615.00	3.00
55	000970	中科三环	1,014,500.00	3.00

56	002385	大北农	1,013,100.00	3.00
57	000558	莱茵体育	1,011,070.50	2.99
58	300014	亿纬锂能	1,007,263.00	2.98
59	600136	当代明诚	1,007,000.00	2.98
60	601777	力帆股份	994,509.00	2.94
61	601186	中国铁建	993,000.00	2.94
62	002615	哈尔斯	990,000.00	2.93
63	002229	鸿博股份	988,732.00	2.92
64	300077	国民技术	987,500.00	2.92
65	600667	太极实业	984,000.00	2.91
66	002341	新纶科技	976,000.00	2.89
67	002618	丹邦科技	972,373.12	2.87
68	002249	大洋电机	972,003.00	2.87
69	002546	新联电子	972,000.00	2.87
70	300027	华谊兄弟	971,750.00	2.87
71	002455	百川股份	961,670.04	2.84
72	002262	恩华药业	958,120.00	2.83
73	002273	水晶光电	954,024.50	2.82
74	300383	光环新网	950,110.00	2.81
75	000876	新希望	943,250.00	2.79
76	000988	华工科技	935,278.00	2.76
77	000538	云南白药	928,500.00	2.74
78	002155	湖南黄金	923,500.00	2.73
79	600521	华海药业	915,036.00	2.71
80	002169	智光电气	908,000.00	2.68
81	000418	小天鹅 A	906,000.00	2.68
82	000333	美的集团	904,500.00	2.67
83	002448	中原内配	903,065.00	2.67
84	600707	彩虹股份	901,114.00	2.66
85	300136	信维通信	895,500.00	2.65
86	601699	潞安环能	895,200.00	2.65
87	002508	老板电器	893,781.00	2.64
88	002247	帝龙新材	892,875.00	2.64
89	000758	中色股份	889,551.00	2.63
90	300037	新宙邦	886,621.74	2.62
91	600111	北方稀土	885,214.00	2.62
92	600157	永泰能源	880,000.00	2.60
93	600702	沱牌舍得	879,750.00	2.60

94	600446	金证股份	876,680.00	2.59
95	600597	光明乳业	875,102.00	2.59
96	300078	思创医惠	874,500.00	2.59
97	000860	顺鑫农业	870,000.00	2.57
98	002488	金固股份	858,400.00	2.54
99	601069	西部黄金	836,560.00	2.47
100	600273	嘉化能源	825,000.00	2.44
101	002707	众信旅游	814,976.00	2.41
102	600303	曙光股份	778,820.00	2.30
103	300365	恒华科技	770,140.00	2.28
104	300097	智云股份	766,500.00	2.27
105	300033	同花顺	765,500.00	2.26
106	300389	艾比森	750,000.00	2.22
107	600392	盛和资源	700,000.00	2.07
108	300048	合康变频	690,600.00	2.04

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	130,743,811.95
卖出股票收入（成交）总额	153,793,124.42

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：无

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：无

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

注：无

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：无

7.12 投资组合报告附注**7.12.1**

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。

7.12.2

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。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	173,837.08
2	应收证券清算款	1,551,768.06
3	应收股利	-
4	应收利息	1,518.11
5	应收申购款	5,190.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,732,313.47

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600576	万家文化	2,834,000.00	8.38	重大事项
2	300323	华灿光电	1,870,000.00	5.53	重大事项
3	000002	万科 A	1,820,000.00	5.38	重大事项
4	300038	梅泰诺	1,264,500.00	3.74	重大事项
5	002355	兴民钢圈	1,054,500.00	3.12	重大事项

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息(转型前)**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,661	27,961.05	39,386,439.03	52.94%	35,017,904.06	47.06%

8.2 期末上市基金前十名持有人

注：无

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	13,665.84	0.02%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 8 基金份额持有人信息(转型后)**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,656	16,621.34	9,236,420.19	20.92%	34,909,846.56	79.08%

8.2 期末上市基金前十名持有人

注：无

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	22,763.88	0.05%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2016 年 4 月 18 日) 基金份额总额	74,404,343.09
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,293,180.74
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	31,551,257.08
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以 "-" 填列)	-
报告期期末基金份额总额	44,146,266.75

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2016 年 3 月 31 日至 2016 年 4 月 15 间以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议了《关于天治品质优选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。基金管理人于 2016 年 4 月 18 日在监督人、公证员的现场监督及律师的现场见证下，统计了本次基金份额持有人大会的表决结果。表决结果详见 2016 年 4 月 20 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及天治基金管理有限公司网站 (www.chinanature.com.cn) 上发布的《天治基金管理有限公司关于天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会令【第 104 号】) 的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本次基金份额持有人大会于 2016 年 4 月 18 日表决通过了《关于天治品质优选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，经天治基金管理有限公司董事会审议通过，聘任吕文龙先生担任公司董事长职务。上述事项已按有关规定报中国基金业协会备案，本基金管理人 2016 年 6 月 21 日在指定媒体及公司网站上刊登了《天治基金管理有限公司关于董事长变更的公告》。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

转型后，本基金投资策略为采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据宏观经济运行态势、政策变化、市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。

转型前，本基金投资策略为以股票品种为主要投资标的，以自下而上的股票优选策略为主，辅以自上而下的类别资产配置、行业资产配置，通过综合运用财务品质、经营品质和市场品质三大评估体系，优选具有长期发展潜力的上市公司股票进行投资，并在投资运作的各个环节实施全面风险预算管理。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民生证券	1	128,113,236.13	45.03%	116,749.87	44.72%	-
安信证券	1	68,267,266.68	23.99%	62,211.71	23.83%	-
东北证券	1	54,517,137.56	19.16%	50,771.71	19.45%	-
长江证券	1	24,897,463.00	8.75%	23,186.72	8.88%	-
申银万国	1	8,085,833.00	2.84%	7,530.37	2.88%	-
银河证券	1	656,000.00	0.23%	610.94	0.23%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华创证券(退)	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-

中金公司	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

注：1、佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。

2、基金专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 经营行为规范，近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时准确地提供信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券公司的交易单元作为本基金专用交易单元，并签订交易单元租用协议。

3、本基金本报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华创证券（退）	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民生证券	1	185,628,231.07	43.99%	169,162.88	43.68%	-
安信证券	1	100,915,065.21	23.91%	91,963.89	23.75%	-
长江证券	1	83,776,245.47	19.85%	78,020.97	20.15%	-
东北证券	1	29,563,332.73	7.01%	27,532.17	7.11%	-
申银万国	1	18,823,198.00	4.46%	17,530.04	4.53%	-
银河证券	1	3,290,277.00	0.78%	3,064.20	0.79%	-
华创证券(退)	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

注：1、佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。

2、基金专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 经营行为规范，近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时准确地提供信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券公司的交易单元作为本基金专用交易单元，并签订交易单元租用协议。

3、本基金本报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的比例

		例		成交总额的 比例		比例
民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-93,000,000.00	45.81%	-	-
东北证券	-	-	-90,000,000.00	44.33%	-	-
申银万国	-	-	-20,000,000.00	9.85%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券(退)	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证监会指定媒体及网站	2016年4月20日
2	天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒体及网站	2016年4月20日
3	天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定媒体及网站	2016年4月20日
4	天治基金管理有限公司关于天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016年4月20日
5	天治基金管理有限公司关于天治品质优选混合型证券投资基金名称变更的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016年4月20日
6	天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金2016年第1季度报告	中国证监会指定媒体及网站	2016年4月21日

7	天治品质优选混合型证券投资基金风险分析季度报告（2016 年第 1 季度）	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 4 月 21 日
8	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持华灿光电股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 4 月 22 日
9	关于天治基金公司淘宝店关闭申购服务的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 5 月 5 日
10	关于天治基金公司网上交易支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 5 月 5 日
11	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持恒锋工具股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 5 月 6 日
12	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持康耐特股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 5 月 12 日
13	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持光一科技股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 6 月 3 日
14	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持兴民钢圈股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 6 月 4 日
15	天治基金管理有限公司关于在陆金所资管开通基金定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 6 月 8 日
16	天治基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 6 月 21 日
17	天治基金管理有限公司旗下部	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 6 月 24 日

	分开放式基金继续参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	体及网站	
18	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持苏交科股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 6 月 29 日

10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天治基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 4 日
2	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持万科 A 股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 6 日
3	天治基金关于指数熔断期间暂停申购赎回业务的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 6 日
4	天治基金关于旗下部分开放式基金参加同花顺基金费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 6 日
5	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持文化长城、梅泰诺、朗姿股份股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 7 日
6	天治基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 7 日

7	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持明家科技、光环新网股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 9 日
8	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持凯撒旅游股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 12 日
9	天治品质优选混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 22 日
10	天治品质优选混合型证券投资基金风险分析季度报告（2015 年 4 季度）	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 22 日
11	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持吴通控股、陆家嘴股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 30 日
12	天治基金管理有限公司关于基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 2 月 3 日
13	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持金叶珠宝股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 2 月 6 日
14	天治品质优选混合型证券投资基金更新的招募说明书（摘要）（2016 年第 1 次更新）	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 2 月 19 日
15	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持中茵股份股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 2 月 24 日
16	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持通源石油股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 2 月 25 日

17	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持中南重工股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 3 月 2 日
18	天治基金管理有限公司关于品质优选混合型证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 3 月 15 日
19	天治公司关于以通讯方式召开天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 3 月 15 日
20	天治基金管理有限公司关于以通讯方式召开天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会第一次提示性公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 3 月 16 日
21	天治基金管理有限公司更正公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 3 月 16 日
22	天治基金管理有限公司关于以通讯方式召开天治品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会第二次提示性公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 3 月 17 日
23	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持姚记扑克股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 3 月 25 日
24	天治品质优选混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 3 月 30 日
25	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持电光科技股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 4 月 1 日
26	天治基金管理有限公司关于调	中国证监会指定媒	2016 年 4 月 8 日

	整旗下基金所持广生堂股票估值方法的公告	体及网站	
27	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持万家文化股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 4 月 16 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

-

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金及天治品质优选混合型证券投资基金募集的文件
2. 《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》
3. 《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》、《天治品质优选混合型证券投资基金招募说明书》
4. 《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《天治品质优选混合型证券投资基金托管协议》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
6. 报告期内天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、天治品质优选混合型证券投资基金公告的各项原稿

12.2 存放地点

上海市复兴西路 159 号

12.3 查阅方式

1. 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:00。投资者可在营业时间免费查阅，

也可按工本费购买复印件。

2. 网站查询: www.chinanature.com.cn

天治基金管理有限公司
2016 年 8 月 29 日