

天治财富增长证券投资基金 2016 年年度 报告 摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：天治基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 23 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金简称 | 天治财富增长混合 |
| 基金主代码 | 350001 |
| 交易代码 | 350001 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004 年 6 月 29 日 |
| 基金管理人 | 天治基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 85,875,894.71 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在确保基金份额净值不低于本基金建立的动态资产保障线的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金建立随时间推移呈非负增长的动态资产保障线，以投资组合保险机制、VaR (Value at Risk) 技术为核心工具，对风险性资产（股票）与低风险资产（债券）的投资比例进行动态调整，并结合下方风险来源分析，对基金的各项资产实施全流程的风险预算管理，力争使基金份额净值高于动态资产保障线水平。在风险可控的基础上，本基金通过积极投资，谋求最大限度地实现基金资产的稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中风险较低、收益稳健的基金品种。 |

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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 赵正中 | 朱萍 |
| | 联系电话 | 021-60371155 | 021-61618888 |
| | 电子邮箱 | zhaozz@chinanature.com.cn | Zhup02@spdb.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-098-4800（免长途通话 | 95528 |

| | | |
|----|------------------|--------------|
| | 费用)、021-60374800 | |
| 传真 | 021-60374934 | 021-63602540 |

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 |

§ 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 | 2016 年 | 2015 年 | 2014 年 |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期已实现收益 | -23,363,985.53 | 91,542,481.79 | 25,509,409.78 |
| 本期利润 | -25,842,489.16 | 62,262,420.74 | 58,434,849.55 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2438 | 0.6138 | 0.2637 |
| 本期基金份额净值增长率 | -22.90% | 41.66% | 37.19% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末 | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0791 | 0.5479 | -0.0589 |
| 期末基金资产净值 | 79,082,155.82 | 122,594,952.51 | 201,711,382.36 |
| 期末基金份额净值 | 0.9209 | 1.5479 | 1.0927 |

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

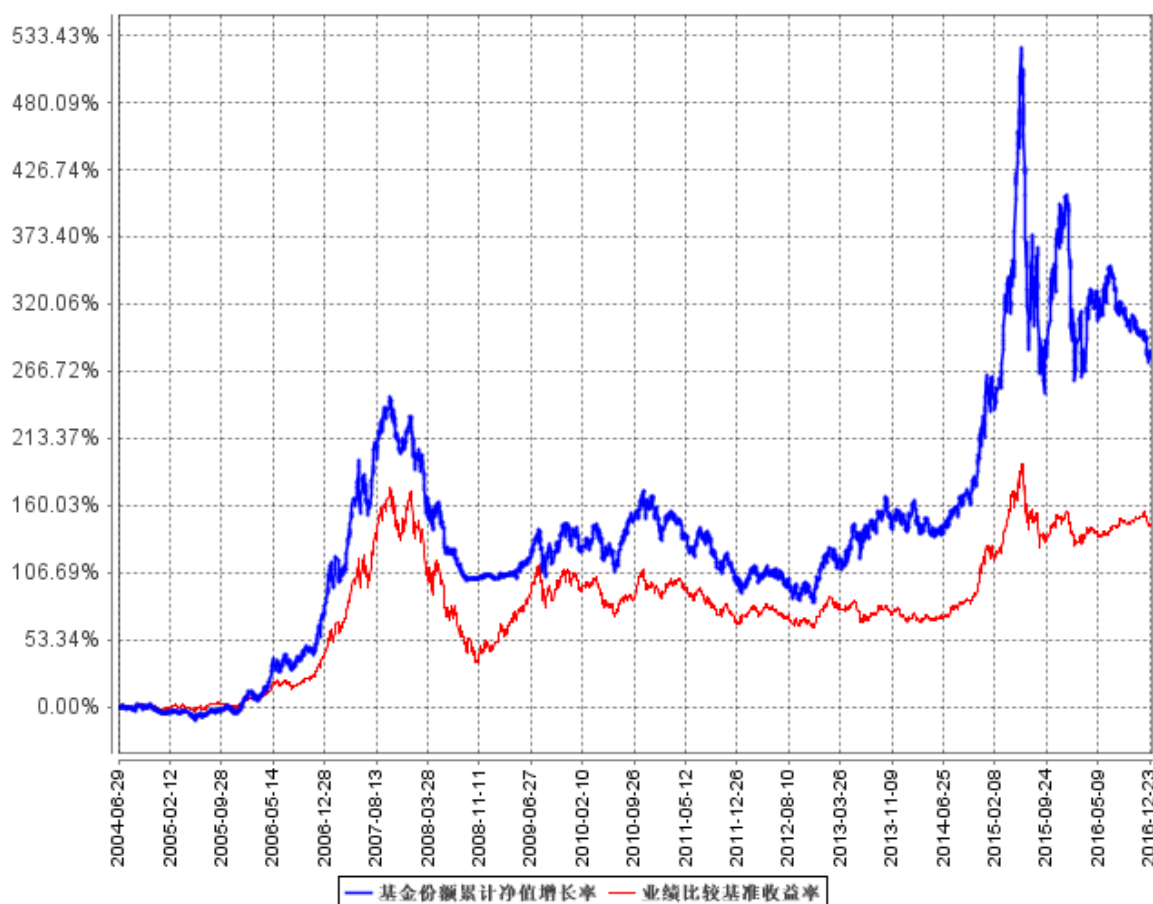
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -6.52% | 0.69% | -0.36% | 0.32% | -6.16% | 0.37% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去六个月 | -14.76% | 0.76% | 2.26% | 0.33% | -17.02% | 0.43% |
| 过去一年 | -22.90% | 1.57% | -2.98% | 0.57% | -19.92% | 1.00% |
| 过去三年 | 49.83% | 1.82% | 41.11% | 0.86% | 8.72% | 0.96% |
| 过去五年 | 88.06% | 1.59% | 46.23% | 0.79% | 41.83% | 0.80% |
| 自基金合同生效起至今 | 278.72% | 2.37% | 145.16% | 0.97% | 133.56% | 1.40% |

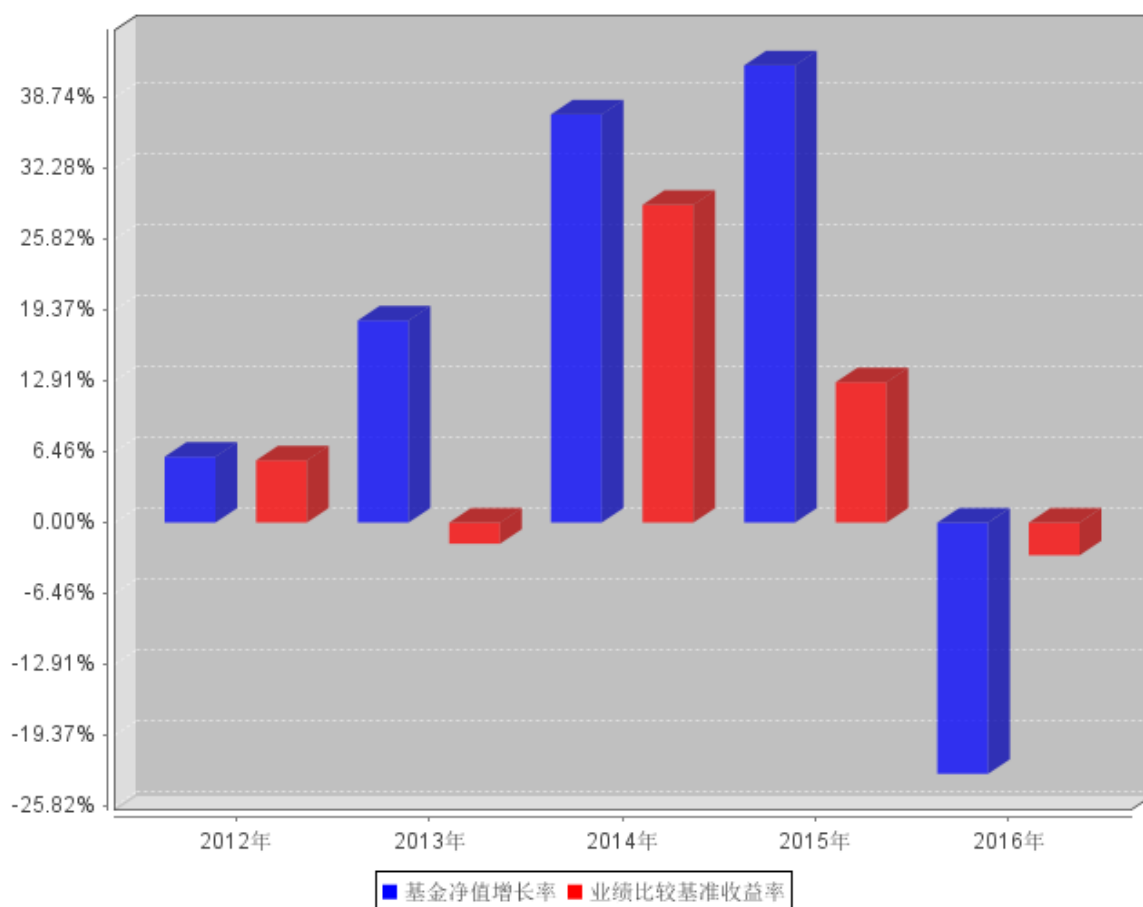
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|------|-------------|---------------|----------------|----------------|----|
| 2016 | 3.0000 | 96,273,642.42 | 122,547,749.04 | 218,821,391.46 | |
| 2015 | - | - | - | - | |
| 2014 | - | - | - | - | |
| 合计 | 3.0000 | 96,273,642.42 | 122,547,749.04 | 218,821,391.46 | |

§ 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 12 月 31 日，本基金管理人旗下共有十一只开放式基金，除本基金外，另外十只基金一天治稳健双盈债券型证券投资基金、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金（转型自 2005 年 1 月 12 日生效的天治品质优选混合型证券投资基金）、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、天治新消费灵活配置混合型证券投资基金（转型自 2011 年 8 月 4 日生效的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（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）、天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的基金合同分别于 2008 年 11 月 5 日、2016 年 4 月 18 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、2016 年 7 月 6 日、2013 年 6 月 4 日、2015 年 6 月 9 日、2016 年 12 月 7 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

| 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 | | |
| 吴昊 | 本基金的基金经理。 | 2015 年 2 月 17 日 | - | 6 | 2010 年 3 月-2012 年 7 月就职于国联证券股份有限公司任行业研究员，2012 年 7 月至今就职于天治基金管理有限公司曾任行业研究员、基金经理助理，现任本基金的基金经理。 |

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合规守信情况的说明

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《天治财富增长证券投资基金基金合同》、《天治财富增长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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定制定了公司《公平交易制度》。公司公平交易体系涵盖研究分析、授权、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，各环节公平措施简要如下：

公司的内外部报告均通过统一的研究管理平台发布，所有的研究员和投资组合经理均有权通过该平台查看公司所有内外部研究报告。

投资组合经理在授权权限范围内做出投资决策，并负责投资决策的具体实施。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。同时，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度。并在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，交易系统将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合。

公司对银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

公司对银行间市场交易价格异常的控制采用事前审查的方法。回购利率异常指回购利率偏离同期公允回购利率 30bp 以上；现券交易价格异常指根据交易价格推算出的收益率偏离同期公允收益率 30bp 以上（一年期以上债券为 50bp），其中，货币基金的现券交易价格异常指根据交易价格推算出的收益率偏离同期公允收益率 30bp 以上。

公司风控人员定期对各投资组合进行业绩归因分析，并于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内，不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。

具体方法如下：

1) 对不同投资组合，根据不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）的每个券种，计算其交

易均价；

2) 对一段时间（季度或年度）同一时间窗口的同个券种进行匹配，计算出价差率；

3) 利用统计方法对多个价差率进行统计分析，分析价差率是否显著大于 0。如果某一资产类别观测期间样本数据太少，则不进行统计检验，仅检查对不同时间窗口（如日内、3 日内、5 日内）的价差率是否超过阈值；

4) 价差率不是显著大于 0 的，则不能说明非公平交易；价差率显著大于 0 的，则需要综合其他因素做出判断，比如交易占优势的投资组合是否收益也显著大于交易占劣势的投资组合。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，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

2016 年 A 股延续上一年大幅波动态势。英国脱欧、美国大选等海外超预期风险事件频频发生。A 股投资主线亦发生“脱虚向实”转变，行业风格切换明显且剧烈。年初由于人民币大幅贬值和熔断机制，再次暴跌。二季度以新能源汽车为主的成长股强势反弹。三季度以 PPP 主导的建筑、环保表现突出。随着供给侧改革深入推进，煤炭、钢铁价格持续走高，PPI 转正，上游行业板块也表现较好。第四季度债券市场出现历史罕见的债灾，国债期货跌停，加上监管层加大对保险投资权益类资产的管制，A 股市场在 12 月出现较大回调。从下半年整体来看，以成长股为主的创业板明显跑输主板，行业风格切换显著。

本基金在上半年坚持持有成长股，表现较为突出。但在下半年未能及时调整行业配置，表现欠佳。我们将继续加大研究，并坚定投资优质的、可跨越周期的成长股，努力实现基金资产的稳定增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末，本基金份额净值为 0.9209 元，报告期内本基金份额净值增长率为-22.90%，业绩比较基准收益率为-2.98%，低于同期业绩比较基准收益率 19.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计 2017 年国内总体需求仍将维持稳定。由于基数效应，PPI 将前高后低，CPI 缓慢上行。供给侧改革将继续发力。钢铁、煤炭等上游资源将维持高位运行。相比 2016 年，2017 年的流动性将逐步收紧，加上新股发行仍然将维持较高频率，这些都会对市场的流动性有一定的冲击。外部因素仍将比较复杂。特朗普上台后的政策可预见性较差，中美贸易摩擦概率加大。另一方面，经过 2016 年一年的调整，部分新兴行业的估值已经回落到一定合理区间，投资价值将逐步显现。我们认为 2017 年股指将维持窄幅波动。注重结构，把握节奏仍将是 2017 年的操作重点。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年，本基金管理人内部监察稽核工作继续坚持规范运作、防范风险、维护投资人利益的原则，在进一步完善、优化公司内控制度的基础上，严格依据法律法规和公司内控制度监督前后台各部门日常工作，切实防控公司运营和投资组合运作的风险，保障公司稳步发展。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作主要包括以下几个方面：

一、进一步完善、优化公司内控制度，加强监察稽核力度。

报告期内，公司制定或修订了《交易部业务手册》、《银行间债券市场交易管理办法》、《专户投资部管理制度》、《员工投资证券投资基金管理办法》、《投资管理人员利益冲突管理制度》、《规章制度管理办法》、《风险准备金制度》、《天治基金管理有限公司自有资金运作管理制度》、《风险控制制度》、《股指期货风险管理制度》、《股指期货投资管理制度》、《国债期货风险管理制度》、《国债期货投资管理制度》、《监察稽核制度》、《融资融券及转融通证券出借业务风险管理制度》、《融资融券及转融通证券出借业务投资管理制度》、《特定客户资产投资管理制度》、《特定客户资产管理业务风险控制制度》、《特定客户资产管理业务危机处理制度》、《特定客户资产管理业务记录及档案管理制度》，已经修改待过会的有《天治基金管理有限公司公募基金压力测试制度》、《计算机设备管理办法》、《天治基金专户业务第三方投资顾问机构管理制度》等管理制度。同时，监察稽核部继续严格依据法律法规和公司规章制度独立行使职责，通过定期或不定期检查、专项检查等方式，监督公司各项制度执行情况（监督监察内容包括但不限于投资组合的投资研究、投资决策、交易执行和投资风险、绩效评估等情况、产品研发流程、基金销售、宣传推介、客户服务、信息技术日常处理及其安全情况、基金结

算各项业务以及公司财务、人事状况等业务环节的合规情况），及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。

二、继续加强投资监控，防范投资运作风险。

报告期内，监察稽核部通过现场检查、电脑实时监控、人员询问、重点抽查等方式，加强事前、事中、事后的风险管理，同时产品创新及量化投资部通过定期对投资组合进行量化风险分析和绩效评估并提供风险分析报告和绩效评估报告等方式进行风险控制，切实贯彻落实公平交易，防范异常交易，确保公司旗下投资组合合法合规运作，切实维护投资人的合法利益。

报告期内，本基金管理人所管理基金的运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，不断完善和优化操作流程，充实和改进内控技术方法与手段，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，防范和控制各种风险，合法合规、诚实信用、勤勉尽责地运作基金财产。

4.7 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、产品创新及量化投资部总监等，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对于权益投资部、固定收益部以及产品创新及量化投资部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，与产品创新及量化投资部一同根据估值模型、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金管理人于 2016 年 4 月 22 日发布的分红公告，本基金本报告期共实施分红 1 次，

为 2015 年度第一次分红。本基金向 2016 年 4 月 27 日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 3.00 元，利润分配合计为人民币 218,821,391.46 元，其中现金形式发放总额为人民币 96,273,642.42 元，红利再投资形式发放总额为人民币 122,547,749.04 元。

4.9 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

报告期内，本基金未出现基金资产净值低于 5000 万元或份额持有人人数少于 200 人的情形。

§ 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对天治财富增长证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对天治财富增长证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了一次利润分配，分配金额为 218,821,391.46 元，其中现金形式发放总额为人民币 96,273,642.42 元，红利再投资形式发放总额为人民币 122,547,749.04 元。

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

本报告期内，由天治基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管

人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 安永华明(2017)审字第 60467615_B01 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题 | 审计报告 |
|--------------|---|
| 审计报告收件人 | 天治财富增长证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 引言段 | 我们审计了后附的天治财富增长证券投资基金财务报表, 包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是基金管理人天治基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表, 并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。 |
| 注册会计师的责任段 | <p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 审计意见段 | 我们认为, 上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制, 公允反映了天治财富增长证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。 |

| | | |
|-----------|--------------------------|-----|
| 注册会计师的姓名 | 朱宝钦 | 丁鹏飞 |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | |
| 会计师事务所的地址 | 上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼 | |
| 审计报告日期 | 2017 年 3 月 24 日 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天治财富增长证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 6,593,115.13 | 22,168,486.50 |
| 结算备付金 | | 970,818.98 | 1,419,109.00 |
| 存出保证金 | | 170,759.67 | 246,026.92 |
| 交易性金融资产 | | 74,201,418.32 | 114,008,281.45 |
| 其中：股票投资 | | 54,471,208.32 | 82,298,081.45 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 19,730,210.00 | 31,710,200.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | 1,142,754.52 | 783,375.70 |
| 应收利息 | | 227,417.09 | 369,835.36 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 27,679.00 | 353,896.17 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 83,333,962.71 | 139,349,011.10 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 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 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | 15,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 2,595,990.31 | 316,209.98 |
| 应付赎回款 | | 43,112.71 | 154,379.25 |
| 应付管理人报酬 | | 102,283.40 | 138,692.45 |
| 应付托管费 | | 17,047.23 | 23,115.41 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 1,429,572.85 | 885,911.35 |
| 应交税费 | | 1,780.00 | - |
| 应付利息 | | - | 1,012.55 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 62,020.39 | 234,737.60 |
| 负债合计 | | 4,251,806.89 | 16,754,058.59 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 85,875,894.71 | 79,200,042.26 |
| 未分配利润 | | -6,793,738.89 | 43,394,910.25 |
| 所有者权益合计 | | 79,082,155.82 | 122,594,952.51 |
| 负债和所有者权益总计 | | 83,333,962.71 | 139,349,011.10 |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9209 元，基金份额总额 85,875,894.71 份。

7.2 利润表

会计主体：天治财富增长证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
|-------------------|-----|---|--|
| 一、收入 | | -18,883,007.23 | 69,494,631.59 |
| 1. 利息收入 | | 1,351,887.38 | 1,994,544.18 |
| 其中：存款利息收入 | | 572,400.29 | 161,168.92 |
| 债券利息收入 | | 779,149.59 | 1,833,375.26 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 337.50 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -18,925,315.10 | 96,731,990.22 |
| 其中：股票投资收益 | | -19,920,984.59 | 84,552,343.43 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 790,867.24 | 12,043,442.31 |

| | | | |
|----------------------------|-----------|----------------|----------------|
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 204,802.25 | 136,204.48 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | -2,478,503.63 | -29,280,061.05 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | | 1,168,924.12 | 48,158.24 |
| 减：二、费用 | | 6,959,481.93 | 7,232,210.85 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.8.2.1 | 1,734,875.03 | 2,037,073.66 |
| 2. 托管费 | 7.4.8.2.2 | 289,145.76 | 339,512.31 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.8.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | | 4,589,823.51 | 4,219,268.74 |
| 5. 利息支出 | | 103,021.48 | 392,355.51 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 103,021.48 | 392,355.51 |
| 6. 其他费用 | | 242,616.15 | 244,000.63 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -25,842,489.16 | 62,262,420.74 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -25,842,489.16 | 62,262,420.74 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治财富增长证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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） | 79,200,042.26 | 43,394,910.25 | 122,594,952.51 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -25,842,489.16 | -25,842,489.16 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | 6,675,852.45 | 194,475,231.48 | 201,151,083.93 |

| | | | |
|--|----------------------------------|-----------------|-----------------|
| (净值减少以“-”号填列) | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 778,716,619.68 | 206,578,784.52 | 985,295,404.20 |
| 2. 基金赎回款 | -772,040,767.23 | -12,103,553.04 | -784,144,320.27 |
| 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） | - | -218,821,391.46 | -218,821,391.46 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 85,875,894.71 | -6,793,738.89 | 79,082,155.82 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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） | 184,591,871.38 | 17,119,510.98 | 201,711,382.36 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 62,262,420.74 | 62,262,420.74 |
| 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） | -105,391,829.12 | -35,987,021.47 | -141,378,850.59 |
| 其中：1. 基金申购款 | 37,185,815.17 | 16,813,415.73 | 53,999,230.90 |
| 2. 基金赎回款 | -142,577,644.29 | -52,800,437.20 | -195,378,081.49 |
| 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） | 79,200,042.26 | 43,394,910.25 | 122,594,952.51 |

注：报告附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|----------|-----------|---------|
| 常永涛 | 闫译文 | 黄宇星 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天治财富增长证券投资基金（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]70号文《关于同意天治财富增长证券投资基金设立的批复》的核准,由基金管理人天治基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2004年6月29日正式生效,首次设立募集规模为952,004,756.57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及注册登记机构为天治基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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。本基金在资产配置中股票投资比例范围为基金资产净值的0-70%,债券投资比例范围为基金资产净值的20%-100%。今后在有关法律法规许可时,本基金将降低债券投资比例范围的下限,相应提高股票投资比例范围的上限。

本基金原业绩比较基准为: 中信标普300指数×40%+中信标普全债指数×60%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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2号《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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[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。

7.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

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。

7.4.7 关联方关系

| 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 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 吉林省信托有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 中国吉林森林工业集团有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 天治北部资产管理有限公司 | 基金管理人控制的子公司 |

7.4.8 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。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注：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。

7.4.8.1.2 债券交易

注：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。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：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。

7.4.8.1.4 权证交易

注：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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,734,875.03 | 2,037,073.66 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 153,935.02 | 236,687.30 |

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 为每日应计提的基金管理费

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，托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 289,145.76 | 339,512.31 |

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 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算，每日计提，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首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：无

7.4.8.3 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与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.5 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1月1日至2016年12月31日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | |
|----------------|-----------------------------|------------|----------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 6,593,115.13 | 514,566.42 | 22,168,486.50 | 135,676.84 |

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.10.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-------------|-----------|--------|-------|--------|--------------|----------|----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 002838 | 道恩股份 | 2016年12月28日 | 2017年1月6日 | 认购新发证券 | 15.28 | 15.28 | 455 | 6,952.40 | 6,952.40 | - |

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票 | 股票 | 停牌 | 停牌 | 期末 | 复牌 | 复牌 | 数量(股) | 期末 | 期末估值总 | 备注 |
|----|----|----|----|----|----|----|-------|----|-------|----|
|----|----|----|----|----|----|----|-------|----|-------|----|

| 代码 | 名称 | 日期 | 原因 | 估值单价 | 日期 | 开盘单价 | | 成本总额 | 额 | |
|--------|------|-------------|--------|-------|------------|-------|---------|--------------|--------------|---|
| 002239 | 奥特佳 | 2016年10月18日 | 重大事项停牌 | 15.69 | 2017年2月7日 | 14.12 | 110,000 | 1,781,977.00 | 1,725,900.00 | - |
| 600576 | 万家文化 | 2016年11月28日 | 重大事项停牌 | 16.61 | 2017年1月12日 | 20.22 | 100,000 | 1,908,378.00 | 1,661,000.00 | - |
| 300450 | 先导智能 | 2016年11月15日 | 重大事项停牌 | 33.99 | 2017年2月8日 | 33.00 | 15,000 | 523,685.00 | 509,850.00 | - |

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 52,362,465.92 元，属于第二层次的余额为人民币 21,838,952.40 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2015 年 12 月 31 日，第一层次的余

额为人民币 72,492,279.65 元，属于第二层次的余额为人民币 41,516,001.80 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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 | 54,471,208.32 | 65.36 |
| | 其中：股票 | 54,471,208.32 | 65.36 |
| 2 | 固定收益投资 | 19,730,210.00 | 23.68 |
| | 其中：债券 | 19,730,210.00 | 23.68 |
| | 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 | 7,563,934.11 | 9.08 |
| 7 | 其他各项资产 | 1,568,610.28 | 1.88 |
| 8 | 合计 | 83,333,962.71 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,932,400.00 | 2.44 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 38,394,638.32 | 48.55 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 10,975,200.00 | 13.88 |
| F | 批发和零售业 | 1,507,970.00 | 1.91 |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| 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 | 1,661,000.00 | 2.10 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 54,471,208.32 | 68.88 |

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 300136 | 信维通信 | 240,000 | 6,840,000.00 | 8.65 |
| 2 | 002456 | 欧菲光 | 185,000 | 6,341,800.00 | 8.02 |
| 3 | 000018 | 神州长城 | 580,000 | 6,206,000.00 | 7.85 |
| 4 | 002366 | 台海核电 | 60,000 | 3,217,200.00 | 4.07 |
| 5 | 300410 | 正业科技 | 35,000 | 1,889,300.00 | 2.39 |
| 6 | 000059 | 华锦股份 | 150,000 | 1,785,000.00 | 2.26 |
| 7 | 002304 | 洋河股份 | 25,000 | 1,765,000.00 | 2.23 |
| 8 | 002239 | 奥特佳 | 110,000 | 1,725,900.00 | 2.18 |
| 9 | 600576 | 万家文化 | 100,000 | 1,661,000.00 | 2.10 |
| 10 | 002583 | 海能达 | 120,000 | 1,585,200.00 | 2.00 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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 | 300136 | 信维通信 | 37,532,061.34 | 30.61 |
| 2 | 002407 | 多氟多 | 25,074,427.87 | 20.45 |
| 3 | 300207 | 欣旺达 | 24,094,087.67 | 19.65 |
| 4 | 002358 | 森源电气 | 22,651,460.71 | 18.48 |
| 5 | 300033 | 同花顺 | 19,435,502.02 | 15.85 |
| 6 | 002245 | 澳洋顺昌 | 18,799,094.06 | 15.33 |
| 7 | 300073 | 当升科技 | 17,429,406.78 | 14.22 |
| 8 | 600869 | 智慧能源 | 16,139,078.67 | 13.16 |
| 9 | 300100 | 双林股份 | 14,181,243.36 | 11.57 |
| 10 | 300014 | 亿纬锂能 | 13,804,154.53 | 11.26 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 11 | 002108 | 沧州明珠 | 13,740,987.00 | 11.21 |
| 12 | 002456 | 欧菲光 | 12,945,080.17 | 10.56 |
| 13 | 300377 | 赢时胜 | 12,915,715.09 | 10.54 |
| 14 | 002517 | 恺英网络 | 12,853,485.45 | 10.48 |
| 15 | 600136 | 当代明诚 | 12,792,045.10 | 10.43 |
| 16 | 002475 | 立讯精密 | 12,684,550.81 | 10.35 |
| 17 | 600576 | 万家文化 | 12,490,477.60 | 10.19 |
| 18 | 300017 | 网宿科技 | 12,159,653.64 | 9.92 |
| 19 | 300059 | 东方财富 | 11,955,844.05 | 9.75 |
| 20 | 300078 | 思创医惠 | 11,636,906.58 | 9.49 |
| 21 | 300096 | 易联众 | 11,583,845.61 | 9.45 |
| 22 | 300061 | 康耐特 | 11,212,142.32 | 9.15 |
| 23 | 002699 | 美盛文化 | 11,046,398.70 | 9.01 |
| 24 | 600158 | 中体产业 | 10,799,270.02 | 8.81 |
| 25 | 300097 | 智云股份 | 10,740,677.65 | 8.76 |
| 26 | 002035 | 华帝股份 | 10,089,486.46 | 8.23 |
| 27 | 603799 | 华友钴业 | 10,076,569.10 | 8.22 |
| 28 | 300231 | 银信科技 | 9,900,904.68 | 8.08 |
| 29 | 300113 | 顺网科技 | 9,815,589.46 | 8.01 |
| 30 | 002280 | 联络互动 | 9,604,035.95 | 7.83 |
| 31 | 002458 | 益生股份 | 9,519,554.46 | 7.77 |
| 32 | 300031 | 宝通科技 | 9,366,397.61 | 7.64 |
| 33 | 300356 | 光一科技 | 9,342,735.12 | 7.62 |
| 34 | 002292 | 奥飞娱乐 | 8,968,252.58 | 7.32 |
| 35 | 002311 | 海大集团 | 8,793,162.46 | 7.17 |
| 36 | 600699 | 均胜电子 | 8,720,879.28 | 7.11 |
| 37 | 002355 | 兴民智通 | 8,533,758.97 | 6.96 |
| 38 | 300383 | 光环新网 | 8,529,888.00 | 6.96 |
| 39 | 300153 | 科泰电源 | 8,517,582.10 | 6.95 |
| 40 | 603609 | 禾丰牧业 | 8,360,420.50 | 6.82 |
| 41 | 600594 | 益佰制药 | 8,318,795.38 | 6.79 |
| 42 | 300160 | 秀强股份 | 8,315,961.00 | 6.78 |
| 43 | 002502 | 骅威文化 | 8,220,095.36 | 6.71 |
| 44 | 600570 | 恒生电子 | 8,082,488.00 | 6.59 |
| 45 | 002051 | 中工国际 | 8,054,416.00 | 6.57 |
| 46 | 300083 | 劲胜精密 | 7,940,562.49 | 6.48 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 47 | 600988 | 赤峰黄金 | 7,860,389.00 | 6.41 |
| 48 | 002340 | 格林美 | 7,605,091.80 | 6.20 |
| 49 | 300296 | 利亚德 | 7,447,517.00 | 6.07 |
| 50 | 000671 | 阳光城 | 7,431,738.23 | 6.06 |
| 51 | 002366 | 台海核电 | 7,380,655.00 | 6.02 |
| 52 | 000018 | 神州长城 | 7,331,878.30 | 5.98 |
| 53 | 600392 | 盛和资源 | 7,303,008.56 | 5.96 |
| 54 | 300144 | 宋城演艺 | 7,292,370.98 | 5.95 |
| 55 | 002643 | 万润股份 | 7,263,290.34 | 5.92 |
| 56 | 300271 | 华宇软件 | 6,935,498.66 | 5.66 |
| 57 | 600068 | 葛洲坝 | 6,773,538.90 | 5.53 |
| 58 | 002384 | 东山精密 | 6,682,573.42 | 5.45 |
| 59 | 002053 | 云南能投 | 6,514,524.90 | 5.31 |
| 60 | 300310 | 宜通世纪 | 6,411,185.66 | 5.23 |
| 61 | 002664 | 信质电机 | 6,372,734.30 | 5.20 |
| 62 | 601668 | 中国建筑 | 6,322,450.00 | 5.16 |
| 63 | 300159 | 新研股份 | 6,310,627.00 | 5.15 |
| 64 | 300237 | 美晨科技 | 6,249,507.50 | 5.10 |
| 65 | 002611 | 东方精工 | 6,175,909.94 | 5.04 |
| 66 | 002730 | 电光科技 | 6,081,993.38 | 4.96 |
| 67 | 000423 | 东阿阿胶 | 6,046,175.00 | 4.93 |
| 68 | 300021 | 大禹节水 | 6,014,991.76 | 4.91 |
| 69 | 300133 | 华策影视 | 6,001,972.16 | 4.90 |
| 70 | 000333 | 美的集团 | 5,933,618.80 | 4.84 |
| 71 | 300444 | 双杰电气 | 5,907,257.76 | 4.82 |
| 72 | 002284 | 亚太股份 | 5,839,069.34 | 4.76 |
| 73 | 002303 | 美盈森 | 5,743,254.10 | 4.68 |
| 74 | 601336 | 新华保险 | 5,728,684.20 | 4.67 |
| 75 | 601198 | 东兴证券 | 5,638,114.76 | 4.60 |
| 76 | 300365 | 恒华科技 | 5,569,214.42 | 4.54 |
| 77 | 300410 | 正业科技 | 5,561,524.70 | 4.54 |
| 78 | 002308 | 威创股份 | 5,550,471.23 | 4.53 |
| 79 | 002587 | 奥拓电子 | 5,516,556.74 | 4.50 |
| 80 | 300408 | 三环集团 | 5,487,058.46 | 4.48 |
| 81 | 601099 | 太平洋 | 5,424,256.00 | 4.42 |
| 82 | 300224 | 正海磁材 | 5,369,448.13 | 4.38 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 83 | 002165 | 红宝丽 | 5,316,556.90 | 4.34 |
| 84 | 600006 | 东风汽车 | 5,283,752.00 | 4.31 |
| 85 | 600667 | 太极实业 | 5,283,039.53 | 4.31 |
| 86 | 600820 | 隧道股份 | 5,247,740.00 | 4.28 |
| 87 | 300302 | 同有科技 | 5,196,508.20 | 4.24 |
| 88 | 601233 | 桐昆股份 | 5,145,731.81 | 4.20 |
| 89 | 600348 | 阳泉煤业 | 5,132,924.00 | 4.19 |
| 90 | 000630 | 铜陵有色 | 5,025,500.00 | 4.10 |
| 91 | 603198 | 迎驾贡酒 | 5,018,306.00 | 4.09 |
| 92 | 601688 | 华泰证券 | 4,801,991.00 | 3.92 |
| 93 | 600340 | 华夏幸福 | 4,735,688.75 | 3.86 |
| 94 | 600562 | 国睿科技 | 4,703,736.00 | 3.84 |
| 95 | 600519 | 贵州茅台 | 4,649,259.70 | 3.79 |
| 96 | 001979 | 招商蛇口 | 4,636,970.70 | 3.78 |
| 97 | 600730 | 中国高科 | 4,624,679.00 | 3.77 |
| 98 | 300324 | 旋极信息 | 4,547,586.54 | 3.71 |
| 99 | 600885 | 宏发股份 | 4,510,444.00 | 3.68 |
| 100 | 600525 | 长园集团 | 4,502,899.60 | 3.67 |
| 101 | 000651 | 格力电器 | 4,447,378.00 | 3.63 |
| 102 | 601555 | 东吴证券 | 4,444,193.00 | 3.63 |
| 103 | 300367 | 东方网力 | 4,442,589.50 | 3.62 |
| 104 | 300409 | 道氏技术 | 4,364,709.16 | 3.56 |
| 105 | 000823 | 超声电子 | 4,360,276.00 | 3.56 |
| 106 | 600651 | 飞乐音响 | 4,336,468.00 | 3.54 |
| 107 | 600259 | 广晟有色 | 4,332,246.00 | 3.53 |
| 108 | 000860 | 顺鑫农业 | 4,311,350.30 | 3.52 |
| 109 | 600547 | 山东黄金 | 4,254,141.00 | 3.47 |
| 110 | 300450 | 先导智能 | 4,223,618.00 | 3.45 |
| 111 | 002714 | 牧原股份 | 4,196,672.90 | 3.42 |
| 112 | 000725 | 京东方 A | 4,136,500.00 | 3.37 |
| 113 | 002157 | 正邦科技 | 4,132,462.45 | 3.37 |
| 114 | 300115 | 长盈精密 | 4,131,848.04 | 3.37 |
| 115 | 002583 | 海能达 | 4,119,171.00 | 3.36 |
| 116 | 002636 | 金安国纪 | 4,093,100.00 | 3.34 |
| 117 | 600030 | 中信证券 | 4,091,476.69 | 3.34 |
| 118 | 000050 | 深天马 A | 4,058,559.41 | 3.31 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 119 | 002635 | 安洁科技 | 3,974,560.25 | 3.24 |
| 120 | 000799 | 酒鬼酒 | 3,942,629.00 | 3.22 |
| 121 | 002460 | 赣锋锂业 | 3,933,175.28 | 3.21 |
| 122 | 000937 | 冀中能源 | 3,932,314.60 | 3.21 |
| 123 | 000983 | 西山煤电 | 3,869,342.50 | 3.16 |
| 124 | 300284 | 苏交科 | 3,854,994.00 | 3.14 |
| 125 | 002445 | 中南文化 | 3,831,439.33 | 3.13 |
| 126 | 300316 | 晶盛机电 | 3,820,557.00 | 3.12 |
| 127 | 600489 | 中金黄金 | 3,805,821.42 | 3.10 |
| 128 | 300088 | 长信科技 | 3,732,051.70 | 3.04 |
| 129 | 603017 | 中衡设计 | 3,724,375.40 | 3.04 |
| 130 | 600066 | 宇通客车 | 3,720,733.00 | 3.03 |
| 131 | 300381 | 溢多利 | 3,654,749.59 | 2.98 |
| 132 | 002508 | 老板电器 | 3,636,268.00 | 2.97 |
| 133 | 000049 | 德赛电池 | 3,633,212.60 | 2.96 |
| 134 | 000892 | 星美联合 | 3,598,436.09 | 2.94 |
| 135 | 600779 | 水井坊 | 3,590,990.00 | 2.93 |
| 136 | 300346 | 南大光电 | 3,559,488.00 | 2.90 |
| 137 | 002371 | 七星电子 | 3,520,788.00 | 2.87 |
| 138 | 000957 | 中通客车 | 3,467,504.00 | 2.83 |
| 139 | 002466 | 天齐锂业 | 3,462,978.00 | 2.82 |
| 140 | 002235 | 安妮股份 | 3,437,725.19 | 2.80 |
| 141 | 000971 | 高升控股 | 3,428,626.62 | 2.80 |
| 142 | 000426 | 兴业矿业 | 3,375,891.00 | 2.75 |
| 143 | 300449 | 汉邦高科 | 3,367,897.00 | 2.75 |
| 144 | 300499 | 高澜股份 | 3,328,607.80 | 2.72 |
| 145 | 000060 | 中金岭南 | 3,327,982.29 | 2.71 |
| 146 | 600754 | 锦江股份 | 3,315,199.72 | 2.70 |
| 147 | 000158 | 常山股份 | 3,312,322.00 | 2.70 |
| 148 | 300065 | 海兰信 | 3,274,494.92 | 2.67 |
| 149 | 002050 | 三花智控 | 3,256,089.00 | 2.66 |
| 150 | 002640 | 跨境通 | 3,220,287.00 | 2.63 |
| 151 | 002425 | 凯撒文化 | 3,219,242.93 | 2.63 |
| 152 | 002590 | 万安科技 | 3,185,144.00 | 2.60 |
| 153 | 002244 | 滨江集团 | 3,166,825.80 | 2.58 |
| 154 | 000960 | 锡业股份 | 3,163,569.00 | 2.58 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 155 | 600172 | 黄河旋风 | 3,158,466.00 | 2.58 |
| 156 | 600563 | 法拉电子 | 3,139,519.00 | 2.56 |
| 157 | 600711 | 盛屯矿业 | 3,121,980.00 | 2.55 |
| 158 | 601998 | 中信银行 | 3,094,463.64 | 2.52 |
| 159 | 600804 | 鹏博士 | 3,064,352.74 | 2.50 |
| 160 | 600782 | 新钢股份 | 3,002,316.00 | 2.45 |
| 161 | 000932 | 华菱钢铁 | 2,982,358.74 | 2.43 |
| 162 | 002522 | 浙江众成 | 2,979,948.53 | 2.43 |
| 163 | 000807 | 云铝股份 | 2,977,191.70 | 2.43 |
| 164 | 000895 | 双汇发展 | 2,955,843.57 | 2.41 |
| 165 | 002200 | 云投生态 | 2,923,777.65 | 2.38 |
| 166 | 002007 | 华兰生物 | 2,899,340.22 | 2.36 |
| 167 | 300008 | 天海防务 | 2,853,045.80 | 2.33 |
| 168 | 600303 | 曙光股份 | 2,798,988.00 | 2.28 |
| 169 | 300379 | 东方通 | 2,740,759.00 | 2.24 |
| 170 | 603026 | 石大胜华 | 2,706,766.25 | 2.21 |
| 171 | 600395 | 盘江股份 | 2,695,514.16 | 2.20 |
| 172 | 002709 | 天赐材料 | 2,692,764.00 | 2.20 |
| 173 | 601069 | 西部黄金 | 2,681,752.00 | 2.19 |
| 174 | 002310 | 东方园林 | 2,675,852.97 | 2.18 |
| 175 | 603008 | 喜临门 | 2,674,244.00 | 2.18 |
| 176 | 601689 | 拓普集团 | 2,661,182.00 | 2.17 |
| 177 | 300068 | 南都电源 | 2,639,783.00 | 2.15 |
| 178 | 601800 | 中国交建 | 2,597,270.76 | 2.12 |
| 179 | 600110 | 诺德股份 | 2,572,365.00 | 2.10 |
| 180 | 002409 | 雅克科技 | 2,558,351.00 | 2.09 |
| 181 | 600338 | 西藏珠峰 | 2,544,175.96 | 2.08 |
| 182 | 600426 | 华鲁恒升 | 2,537,990.21 | 2.07 |
| 183 | 300496 | 中科创达 | 2,516,633.00 | 2.05 |
| 184 | 600977 | 中国电影 | 2,507,830.00 | 2.05 |
| 185 | 600418 | 江淮汽车 | 2,505,964.43 | 2.04 |
| 186 | 600963 | 岳阳林纸 | 2,503,197.90 | 2.04 |
| 187 | 002074 | 国轩高科 | 2,494,074.67 | 2.03 |
| 188 | 002026 | 山东威达 | 2,487,125.77 | 2.03 |
| 189 | 600487 | 亨通光电 | 2,479,805.00 | 2.02 |
| 190 | 300491 | 通合科技 | 2,477,926.00 | 2.02 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 191 | 002329 | 皇氏集团 | 2,476,025.67 | 2.02 |
| 192 | 300493 | 润欣科技 | 2,471,959.50 | 2.02 |
| 193 | 300369 | 绿盟科技 | 2,458,445.92 | 2.01 |

8.4.2 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 | 300136 | 信维通信 | 32,589,212.27 | 26.58 |
| 2 | 002407 | 多氟多 | 25,750,358.93 | 21.00 |
| 3 | 300207 | 欣旺达 | 24,509,218.64 | 19.99 |
| 4 | 002358 | 森源电气 | 21,314,671.76 | 17.39 |
| 5 | 300033 | 同花顺 | 19,570,089.60 | 15.96 |
| 6 | 002245 | 澳洋顺昌 | 18,047,517.67 | 14.72 |
| 7 | 300073 | 当升科技 | 17,643,335.69 | 14.39 |
| 8 | 600869 | 智慧能源 | 16,269,503.79 | 13.27 |
| 9 | 002517 | 恺英网络 | 15,379,870.26 | 12.55 |
| 10 | 300100 | 双林股份 | 14,748,906.46 | 12.03 |
| 11 | 002108 | 沧州明珠 | 14,609,229.65 | 11.92 |
| 12 | 300078 | 思创医惠 | 14,352,709.22 | 11.71 |
| 13 | 300096 | 易联众 | 13,921,947.72 | 11.36 |
| 14 | 002280 | 联络互动 | 12,998,604.27 | 10.60 |
| 15 | 002475 | 立讯精密 | 12,972,700.46 | 10.58 |
| 16 | 300377 | 赢时胜 | 12,902,964.40 | 10.52 |
| 17 | 600136 | 当代明诚 | 12,728,515.98 | 10.38 |
| 18 | 300014 | 亿纬锂能 | 12,645,209.52 | 10.31 |
| 19 | 002699 | 美盛文化 | 12,610,237.17 | 10.29 |
| 20 | 300017 | 网宿科技 | 12,426,710.70 | 10.14 |
| 21 | 300059 | 东方财富 | 12,086,825.28 | 9.86 |
| 22 | 300113 | 顺网科技 | 11,944,402.46 | 9.74 |
| 23 | 300231 | 银信科技 | 11,594,020.36 | 9.46 |
| 24 | 300061 | 康耐特 | 11,236,430.50 | 9.17 |
| 25 | 600158 | 中体产业 | 11,092,967.00 | 9.05 |
| 26 | 300097 | 智云股份 | 11,042,371.02 | 9.01 |
| 27 | 600576 | 万家文化 | 10,185,125.60 | 8.31 |
| 28 | 002458 | 益生股份 | 9,827,473.70 | 8.02 |
| 29 | 603799 | 华友钴业 | 9,727,666.88 | 7.93 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 30 | 002292 | 奥飞娱乐 | 9,669,435.38 | 7.89 |
| 31 | 002035 | 华帝股份 | 9,419,767.68 | 7.68 |
| 32 | 300356 | 光一科技 | 9,107,495.10 | 7.43 |
| 33 | 600699 | 均胜电子 | 8,957,752.05 | 7.31 |
| 34 | 600392 | 盛和资源 | 8,786,590.62 | 7.17 |
| 35 | 300031 | 宝通科技 | 8,781,162.40 | 7.16 |
| 36 | 300310 | 宜通世纪 | 8,764,840.04 | 7.15 |
| 37 | 002311 | 海大集团 | 8,740,430.88 | 7.13 |
| 38 | 002502 | 骅威文化 | 8,561,315.76 | 6.98 |
| 39 | 600570 | 恒生电子 | 8,540,366.00 | 6.97 |
| 40 | 300160 | 秀强股份 | 8,356,723.60 | 6.82 |
| 41 | 002355 | 兴民智通 | 8,346,829.28 | 6.81 |
| 42 | 600594 | 益佰制药 | 8,302,827.45 | 6.77 |
| 43 | 300296 | 利亚德 | 8,218,634.62 | 6.70 |
| 44 | 603609 | 禾丰牧业 | 8,115,484.73 | 6.62 |
| 45 | 300083 | 劲胜精密 | 8,053,545.32 | 6.57 |
| 46 | 300383 | 光环新网 | 8,007,133.82 | 6.53 |
| 47 | 600988 | 赤峰黄金 | 7,972,229.34 | 6.50 |
| 48 | 300153 | 科泰电源 | 7,871,173.34 | 6.42 |
| 49 | 002340 | 格林美 | 7,765,125.32 | 6.33 |
| 50 | 300144 | 宋城演艺 | 7,536,895.25 | 6.15 |
| 51 | 300271 | 华宇软件 | 7,479,871.43 | 6.10 |
| 52 | 002643 | 万润股份 | 7,309,046.61 | 5.96 |
| 53 | 000671 | 阳光城 | 7,197,641.60 | 5.87 |
| 54 | 600068 | 葛洲坝 | 6,792,330.82 | 5.54 |
| 55 | 002051 | 中工国际 | 6,704,017.69 | 5.47 |
| 56 | 002456 | 欧菲光 | 6,627,408.15 | 5.41 |
| 57 | 002053 | 云南能投 | 6,438,206.40 | 5.25 |
| 58 | 002664 | 信质电机 | 6,398,684.50 | 5.22 |
| 59 | 002384 | 东山精密 | 6,227,462.74 | 5.08 |
| 60 | 300159 | 新研股份 | 6,206,952.32 | 5.06 |
| 61 | 000423 | 东阿阿胶 | 6,141,063.76 | 5.01 |
| 62 | 300237 | 美晨科技 | 6,118,336.74 | 4.99 |
| 63 | 300021 | 大禹节水 | 5,918,872.04 | 4.83 |
| 64 | 002303 | 美盈森 | 5,886,284.17 | 4.80 |
| 65 | 300444 | 双杰电气 | 5,874,234.00 | 4.79 |
| 66 | 002730 | 电光科技 | 5,809,271.79 | 4.74 |
| 67 | 000333 | 美的集团 | 5,781,838.00 | 4.72 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 68 | 002308 | 威创股份 | 5,763,393.00 | 4.70 |
| 69 | 601198 | 东兴证券 | 5,762,119.00 | 4.70 |
| 70 | 002284 | 亚太股份 | 5,739,279.32 | 4.68 |
| 71 | 002587 | 奥拓电子 | 5,615,593.60 | 4.58 |
| 72 | 002165 | 红宝丽 | 5,547,145.60 | 4.52 |
| 73 | 300133 | 华策影视 | 5,506,553.02 | 4.49 |
| 74 | 300408 | 三环集团 | 5,490,353.00 | 4.48 |
| 75 | 300450 | 先导智能 | 5,484,692.00 | 4.47 |
| 76 | 601099 | 太平洋 | 5,461,892.00 | 4.46 |
| 77 | 300365 | 恒华科技 | 5,327,944.45 | 4.35 |
| 78 | 300224 | 正海磁材 | 5,285,733.00 | 4.31 |
| 79 | 300302 | 同有科技 | 5,269,196.72 | 4.30 |
| 80 | 601233 | 桐昆股份 | 5,248,151.85 | 4.28 |
| 81 | 300324 | 旋极信息 | 5,214,943.46 | 4.25 |
| 82 | 600667 | 太极实业 | 5,209,048.25 | 4.25 |
| 83 | 600006 | 东风汽车 | 5,137,922.44 | 4.19 |
| 84 | 601336 | 新华保险 | 5,103,304.17 | 4.16 |
| 85 | 600348 | 阳泉煤业 | 5,094,893.08 | 4.16 |
| 86 | 601688 | 华泰证券 | 5,082,929.10 | 4.15 |
| 87 | 001979 | 招商蛇口 | 5,047,890.00 | 4.12 |
| 88 | 603198 | 迎驾贡酒 | 4,987,609.66 | 4.07 |
| 89 | 601668 | 中国建筑 | 4,950,855.00 | 4.04 |
| 90 | 300367 | 东方网力 | 4,903,678.00 | 4.00 |
| 91 | 000892 | 星美联合 | 4,852,339.46 | 3.96 |
| 92 | 000823 | 超声电子 | 4,824,611.64 | 3.94 |
| 93 | 600885 | 宏发股份 | 4,810,257.00 | 3.92 |
| 94 | 002611 | 东方精工 | 4,786,253.69 | 3.90 |
| 95 | 600519 | 贵州茅台 | 4,695,205.40 | 3.83 |
| 96 | 603008 | 喜临门 | 4,604,726.02 | 3.76 |
| 97 | 600562 | 国睿科技 | 4,593,617.53 | 3.75 |
| 98 | 600340 | 华夏幸福 | 4,545,497.70 | 3.71 |
| 99 | 601628 | 中国人寿 | 4,423,642.00 | 3.61 |
| 100 | 601555 | 东吴证券 | 4,382,044.00 | 3.57 |
| 101 | 000860 | 顺鑫农业 | 4,355,429.00 | 3.55 |
| 102 | 300115 | 长盈精密 | 4,328,341.00 | 3.53 |
| 103 | 002635 | 安洁科技 | 4,328,061.27 | 3.53 |
| 104 | 600259 | 广晟有色 | 4,319,374.06 | 3.52 |
| 105 | 000050 | 深天马 A | 4,259,044.01 | 3.47 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 106 | 600525 | 长园集团 | 4,248,402.00 | 3.47 |
| 107 | 600547 | 山东黄金 | 4,247,037.50 | 3.46 |
| 108 | 002329 | 皇氏集团 | 4,242,679.68 | 3.46 |
| 109 | 002279 | 久其软件 | 4,198,103.00 | 3.42 |
| 110 | 300409 | 道氏技术 | 4,192,704.20 | 3.42 |
| 111 | 600820 | 隧道股份 | 4,187,069.44 | 3.42 |
| 112 | 002636 | 金安国纪 | 4,182,882.00 | 3.41 |
| 113 | 600730 | 中国高科 | 4,162,179.00 | 3.40 |
| 114 | 000937 | 冀中能源 | 4,127,613.42 | 3.37 |
| 115 | 002445 | 中南文化 | 4,087,328.00 | 3.33 |
| 116 | 600651 | 飞乐音响 | 4,049,821.63 | 3.30 |
| 117 | 600030 | 中信证券 | 4,048,563.00 | 3.30 |
| 118 | 300284 | 苏交科 | 4,038,137.92 | 3.29 |
| 119 | 000799 | 酒鬼酒 | 3,932,370.60 | 3.21 |
| 120 | 300088 | 长信科技 | 3,881,709.00 | 3.17 |
| 121 | 002717 | 岭南园林 | 3,861,533.62 | 3.15 |
| 122 | 000983 | 西山煤电 | 3,851,291.80 | 3.14 |
| 123 | 600589 | 广东榕泰 | 3,849,634.00 | 3.14 |
| 124 | 600066 | 宇通客车 | 3,831,598.14 | 3.13 |
| 125 | 002714 | 牧原股份 | 3,802,088.00 | 3.10 |
| 126 | 002366 | 台海核电 | 3,797,358.00 | 3.10 |
| 127 | 300316 | 晶盛机电 | 3,791,569.00 | 3.09 |
| 128 | 002172 | 澳洋科技 | 3,781,145.88 | 3.08 |
| 129 | 300048 | 合康新能 | 3,773,560.00 | 3.08 |
| 130 | 600489 | 中金黄金 | 3,759,374.00 | 3.07 |
| 131 | 603017 | 中衡设计 | 3,753,113.44 | 3.06 |
| 132 | 002157 | 正邦科技 | 3,730,676.00 | 3.04 |
| 133 | 300346 | 南大光电 | 3,692,376.82 | 3.01 |
| 134 | 300410 | 正业科技 | 3,692,353.00 | 3.01 |
| 135 | 002460 | 赣锋锂业 | 3,662,187.00 | 2.99 |
| 136 | 002508 | 老板电器 | 3,638,686.00 | 2.97 |
| 137 | 002371 | 七星电子 | 3,620,743.54 | 2.95 |
| 138 | 300499 | 高澜股份 | 3,595,311.00 | 2.93 |
| 139 | 600779 | 水井坊 | 3,581,548.00 | 2.92 |
| 140 | 002466 | 天齐锂业 | 3,569,134.48 | 2.91 |
| 141 | 300458 | 全志科技 | 3,516,257.62 | 2.87 |
| 142 | 000158 | 常山股份 | 3,507,863.20 | 2.86 |
| 143 | 300299 | 富春通信 | 3,478,666.00 | 2.84 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 144 | 000049 | 德赛电池 | 3,472,414.73 | 2.83 |
| 145 | 000426 | 兴业矿业 | 3,398,752.00 | 2.77 |
| 146 | 300008 | 天海防务 | 3,380,505.00 | 2.76 |
| 147 | 600754 | 锦江股份 | 3,362,910.00 | 2.74 |
| 148 | 600563 | 法拉电子 | 3,355,088.00 | 2.74 |
| 149 | 300381 | 溢多利 | 3,345,888.71 | 2.73 |
| 150 | 000060 | 中金岭南 | 3,331,722.75 | 2.72 |
| 151 | 002235 | 安妮股份 | 3,301,810.00 | 2.69 |
| 152 | 000630 | 铜陵有色 | 3,268,000.00 | 2.67 |
| 153 | 000957 | 中通客车 | 3,267,785.82 | 2.67 |
| 154 | 002590 | 万安科技 | 3,267,282.54 | 2.67 |
| 155 | 000971 | 高升控股 | 3,258,344.34 | 2.66 |
| 156 | 300449 | 汉邦高科 | 3,199,296.00 | 2.61 |
| 157 | 000960 | 锡业股份 | 3,192,306.78 | 2.60 |
| 158 | 002050 | 三花智控 | 3,185,297.50 | 2.60 |
| 159 | 002739 | 万达院线 | 3,164,818.92 | 2.58 |
| 160 | 000807 | 云铝股份 | 3,153,987.77 | 2.57 |
| 161 | 000725 | 京东方 A | 3,149,500.00 | 2.57 |
| 162 | 600711 | 盛屯矿业 | 3,135,149.00 | 2.56 |
| 163 | 600804 | 鹏博士 | 3,117,660.00 | 2.54 |
| 164 | 002425 | 凯撒文化 | 3,110,072.00 | 2.54 |
| 165 | 000651 | 格力电器 | 3,095,538.00 | 2.53 |
| 166 | 000932 | 华菱钢铁 | 3,055,184.00 | 2.49 |
| 167 | 600782 | 新钢股份 | 3,044,589.60 | 2.48 |
| 168 | 601998 | 中信银行 | 3,043,502.58 | 2.48 |
| 169 | 600172 | 黄河旋风 | 3,028,791.00 | 2.47 |
| 170 | 000895 | 双汇发展 | 3,007,960.78 | 2.45 |
| 171 | 002007 | 华兰生物 | 3,002,348.48 | 2.45 |
| 172 | 002310 | 东方园林 | 2,934,002.95 | 2.39 |
| 173 | 002244 | 滨江集团 | 2,883,841.20 | 2.35 |
| 174 | 601689 | 拓普集团 | 2,866,062.00 | 2.34 |
| 175 | 002522 | 浙江众成 | 2,855,608.00 | 2.33 |
| 176 | 600303 | 曙光股份 | 2,781,318.00 | 2.27 |
| 177 | 601069 | 西部黄金 | 2,779,330.65 | 2.27 |
| 178 | 300491 | 通合科技 | 2,725,049.00 | 2.22 |
| 179 | 300379 | 东方通 | 2,697,590.00 | 2.20 |
| 180 | 300065 | 海兰信 | 2,693,229.50 | 2.20 |
| 181 | 300068 | 南都电源 | 2,676,792.82 | 2.18 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 182 | 600395 | 盘江股份 | 2,667,754.57 | 2.18 |
| 183 | 300242 | 明家联合 | 2,644,518.85 | 2.16 |
| 184 | 300496 | 中科创达 | 2,572,383.20 | 2.10 |
| 185 | 600831 | 广电网络 | 2,562,272.00 | 2.09 |
| 186 | 002583 | 海能达 | 2,543,013.00 | 2.07 |
| 187 | 601800 | 中国交建 | 2,520,440.51 | 2.06 |
| 188 | 002200 | 云投生态 | 2,517,934.55 | 2.05 |
| 189 | 002026 | 山东威达 | 2,493,661.00 | 2.03 |
| 190 | 300493 | 润欣科技 | 2,473,082.68 | 2.02 |
| 191 | 600110 | 诺德股份 | 2,470,902.94 | 2.02 |

注：表中“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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 | 1,553,906,451.52 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,560,296,190.37 |

注：表中“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 12,957,750.00 | 16.39 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 4,977,500.00 | 6.29 |
| | 其中：政策性金融债 | 4,977,500.00 | 6.29 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,794,960.00 | 2.27 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 19,730,210.00 | 24.95 |

8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 019539 | 16 国债 11 | 50,000 | 4,993,500.00 | 6.31 |
| 2 | 160419 | 16 农发 19 | 50,000 | 4,977,500.00 | 6.29 |
| 3 | 010303 | 03 国债(3) | 40,000 | 4,070,000.00 | 5.15 |
| 4 | 010107 | 21 国债(7) | 37,000 | 3,894,250.00 | 4.92 |
| 5 | 128010 | 顺昌转债 | 8,000 | 948,240.00 | 1.20 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

台海核电（002366）因未及时披露公司重大事项，深圳证券交易所于 2016 年 8 月 18 日依据相关法规给予公开批评处分决定。

万家文化（600576）因信息披露虚假或严重误导性陈述，未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责，上海证券交易所于 2016 年 11 月 9 日依据相关法规给予公开批评处分决定。

相关投资决策程序符合法律法规及公司相关制度规定。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 170,759.67 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,142,754.52 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 227,417.09 |
| 5 | 应收申购款 | 27,679.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,568,610.28 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|---------------|
| 1 | 128010 | 顺昌转债 | 948,240.00 | 1.20 |
| 2 | 128009 | 歌尔转债 | 846,720.00 | 1.07 |

8.12.5 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 | 002239 | 奥特佳 | 1,725,900.00 | 2.18 | 重大事项 |
| 2 | 600576 | 万家文化 | 1,661,000.00 | 2.10 | 重大事项 |
| 3 | 002838 | 道恩股份 | 6,952.40 | 0.01 | 认购新发行证券 |
| 4 | 300450 | 先导智能 | 509,850.00 | 0.64 | 重大事项 |

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 |
| 3,971 | 21,625.76 | 12,418,064.63 | 14.46% | 73,457,830.08 | 85.54% |

9.3 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 | 41,232.51 | 0.05% |

9.4 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2004年6月29日）基金份额总额 | 952,004,756.57 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 79,200,042.26 |
| 本报告期基金总申购份额 | 778,716,619.68 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 772,040,767.23 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 85,875,894.71 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 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、中国证券监督管理委员会上海监管局备案，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》。

自2016年1月起，上海浦东发展银行股份有限公司进行组织结构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来，未变更过会计师事务所。

本报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬为 4 万元整。目前的审计机构—安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已提供审计服务的连续年限为自 2004 年 6 月 29 日至今。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 | |
| 东吴证券 | 2 | 1,011,402,127.20 | 32.55% | 921,691.32 | 33.57% | - |
| 海通证券 | 1 | 554,961,959.83 | 17.86% | 516,834.11 | 18.82% | - |
| 东北证券 | 1 | 523,088,230.99 | 16.80% | 372,073.24 | 13.53% | - |
| 国泰君安 | 1 | 308,300,047.96 | 9.92% | 287,119.01 | 10.46% | - |
| 光大证券 | 1 | 289,333,033.09 | 9.31% | 263,669.62 | 9.60% | - |
| 国海证券 | 1 | 197,225,328.83 | 6.35% | 179,731.59 | 6.55% | - |
| 广发证券 | 1 | 168,033,872.54 | 5.41% | 153,128.92 | 5.58% | - |
| 兴业证券 | 1 | 61,503,726.88 | 1.98% | 56,048.38 | 2.04% | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、上述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、本基金本报告期内退租万联证券有限责任公司一个交易单元。

11.7.2 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 |
| 东吴证券 | 10,005,992.36 | 7.03% | - | - | - | - |
| 海通证券 | 88,867,940.86 | 62.45% | 66,100,000.00 | 65.58% | - | - |
| 东北证券 | 4,051,272.60 | 2.85% | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 33,749,153.14 | 23.72% | 34,700,000.00 | 34.42% | - | - |
| 光大证券 | 2,874,030.45 | 2.02% | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1,669,973.91 | 1.17% | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1,075,974.87 | 0.76% | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |

天治基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日