

# 天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年年度报告

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：交通银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 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。

基金托管人交通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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	9
2.3 基金管理人和基金托管人.....	9
2.4 信息披露方式.....	10
2.5 其他相关资料.....	10
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现（转型后）.....	11
3.2 基金净值表现（转型前）.....	13
3.3 其他指标.....	15
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	15
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	18
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
4.10 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.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>21</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	22
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.....	22
<b>§6 审计报告（转型后）</b> .....	<b>22</b>
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
<b>§6 审计报告（转型前）</b> .....	<b>23</b>
6.1 审计报告基本信息.....	23
6.2 审计报告的基本内容.....	23
<b>§7 年度财务报表（转型后）</b> .....	<b>24</b>
7.1 资产负债表（转型后）.....	24
7.2 利润表.....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	27

<b>§7 年度财务报表（转型前）</b> .....	<b>49</b>
7.1 资产负债表（转型前） .....	49
7.2 利润表 .....	50
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	52
7.4 报表附注 .....	53
<b>§8 投资组合报告（转型后）</b> .....	<b>75</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	75
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	75
8.3 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 .....	76
8.2 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	77
8.3 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	88
8.4 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 .....	89
8.5 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 .....	89
8.6 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 .....	89
8.7 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 .....	89
8.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	89
8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	89
8.10 投资组合报告附注 .....	89
<b>§8 投资组合报告（转型前）</b> .....	<b>90</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	90
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	91
8.3 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 .....	92
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	93
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	99
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 .....	99
8.7 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 .....	99
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 .....	99
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 .....	99
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	99
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	100
8.12 投资组合报告附注 .....	100
<b>§9 基金份额持有人信息（转型后）</b> .....	<b>101</b>
9.3 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	101
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	101
9.5 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 .....	102
<b>§9 基金份额持有人信息（转型前）</b> .....	<b>102</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	102
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	102
9.3 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 .....	102
<b>§10 开放式基金份额变动(转型后)</b> .....	<b>102</b>
<b>§10 开放式基金份额变动(转型前)</b> .....	<b>103</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>103</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	103
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 .....	103
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	104

11.4 基金投资策略的改变.....	104
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	104
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.....	104
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....	104
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....	106
11.9 其他重大事件（转型后）.....	107
11.9 其他重大事件（转型前）.....	111
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>错误！未定义书签。</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>114</b>
13.1 备查文件目录.....	114
13.2 存放地点.....	114
13.3 查阅方式.....	114

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	天治中国制造 2025
基金主代码	350005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 7 日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,960,617.70 份
基金合同存续期	不定期

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	天治创新先锋混合型证券投资基金
基金简称	天治创新先锋
基金主代码	350005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 5 月 8 日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	24,102,991.31 份
基金合同存续期	不定期

### 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，精选受益于中国制造 2025 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>资产配置策略是指基于宏观经济和证券市场运行环境的整体研究，结合内部和外部的研究支持，本基金管理人分析判断股票和债券估值的相对吸引力，从而决定各大类资产配置比例的调整方案，进行主动的仓位控制。</p> <p>本基金为混合型基金，以股票投资为主，一般情况下本基金将保持配置的基本稳定，最高可达 95%。当股票市场的整体估值水平严重偏离企业实际的盈利状况和预期成长率，出现明显的价值高估，如果不及时调整将可能给基金持有人带来潜在的资本损失时，本基金将进行大类资产配置调整，降低股票资产的比例（最</p>

	<p>低为 0%),同时利用提高债券配置比例及利用股指期货进行套期保值等方法规避市场系统性风险。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金“中国制造 2025”的投资主题源自国务院 2015 年印发的《中国制造 2025》,这是中国制造业未来发展设计的顶层规划和路线图,是我国实施制造强国战略第一个十年的行动纲领。制造业主要领域具有创新引领能力和明显竞争优势,建成全球领先的技术体系和产业体系。本基金将沿着国家对制造业中长期规划路线,把握其中蕴含的投资机会。</p> <p>(1) 主题行业的选择</p> <p>围绕《中国制造 2025》的战略任务和重点,本基金将符合以下条件的行业纳入主题投资范围:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1) 具有国家制造业创新能力,如核心技术革新、创新设计能力、科研成果产业化、新一代信息技术、新工艺等;</li> <li>2) 有助于推进信息化与工业化深度融合,如智能制造、智能装备和产品、智能化管理、智能化服务、互联网应用、互联网基础设施、智能制造网络系统平台等;</li> <li>3) 具备强化工业基础能力,如核心基础零部件、先进基础工艺、关键基础材料等;</li> <li>4) 与“绿色制造”概念相关,如传统工艺的绿色改造升级、节能环保技术、污染防治技术、资源高效循环利用、新能源等;</li> <li>5) 处于酝酿产业结构调整阶段,如企业技术改造、过剩产能消化、产业布局优化等;</li> <li>6) 属于服务型制造业及生产性服务业,如从提供产品向提供整体解决方案转型、专业服务输出、制造业金融,及对接制造业的移动电子商务、科技服务业、第三方物流、融资租赁等。</li> </ol> <p>本基金的核心关注板块是《中国制造 2025》明确的十大重点领域,包括新一代信息技术产业、高档数控机床和机器人、航空航天装备、海洋工程装备及高技术船舶、先进轨道交通装备、节能与新能源汽车、电力装备、农机装备、新材料、生物医药及高性能医疗器械等。</p> <p>基金管理人将持续跟踪国家政策、产业发展趋势、技术、工艺、商业模式的最新变化,并可据以对“中国制造 2025”主题相关行业的范围进行动态调整。</p> <p>(2) 个股投资策略</p> <p>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,精选受益于中国制造 2025 主题相关企业进行重点投资。</p> <p>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</p>
--	---

	<p>产收益率和毛利率并辅以经营性现金净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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p><b>3、债券投资策略</b></p> <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><b>4、权证投资策略</b></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><b>5、资产支持证券投资策略</b></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</p>
--	--

	<p>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	本基金的业绩比较基准为：申银万国制造业指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。
风险收益特征	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。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	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。
投资策略	本基金以股票品种为主要投资标的，优选通过差异化和低成本不断创造新价值、追求持续领先优势的创新先锋型公司，分享其价值创新带来的高成长收益。
业绩比较基准	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	本基金为具有较高收益、较高风险的混合型基金。

## 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵正中	汤嵩彦
	联系电话	021-60371155	95559

	电子邮箱	zhaozz@chinanature.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-098-4800 (免长途通话费用)、 021-60374800	95559
传真		021-60374934	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号 楼 231 室	上海市浦东新区银城中 路 188 号
办公地址		上海市复兴西路 159 号	上海市浦东新区银城中 路 188 号
邮政编码		200031	200120
法定代表人		赵玉彪	牛锡明

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	808,694.16
本期利润	-1,866,992.56
加权平均基金份额本期利润	-0.0781
本期加权平均净值利润率	-4.96%
本期基金份额净值增长率	-5.25%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	11,303,611.19
期末可供分配基金份额利润	0.4923
期末基金资产净值	34,264,228.89
期末基金份额净值	1.4923

<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2016年12月31日
基金份额累计净值增长率	-5.25%

转型前

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2016年1月1日至 2016年4月6日	2015年	2014年
本期已实现收益	-10,327,643.10	42,498,098.96	2,595,030.37
本期利润	-9,615,795.67	31,217,058.49	11,401,937.36
加权平均基金份额本期利润	-0.3823	0.9246	0.0872
本期加权平均净值利润率	-26.11%	49.50%	6.76%
本期基金份额净值增长率	-21.09%	32.46%	13.94%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2016年4月6日	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	12,786,074.92	23,486,427.67	14,825,506.45
期末可供分配基金份额利润	0.5305	0.9959	0.2105
期末基金资产净值	37,963,264.08	47,070,433.20	106,121,539.08
期末基金份额净值	1.5750	1.9959	1.5068
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2016年4月6日	2015年末	2014年末
基金份额累计净值增长率	57.50%	99.59%	50.68%

## 3.2 基金净值表现（转型后）

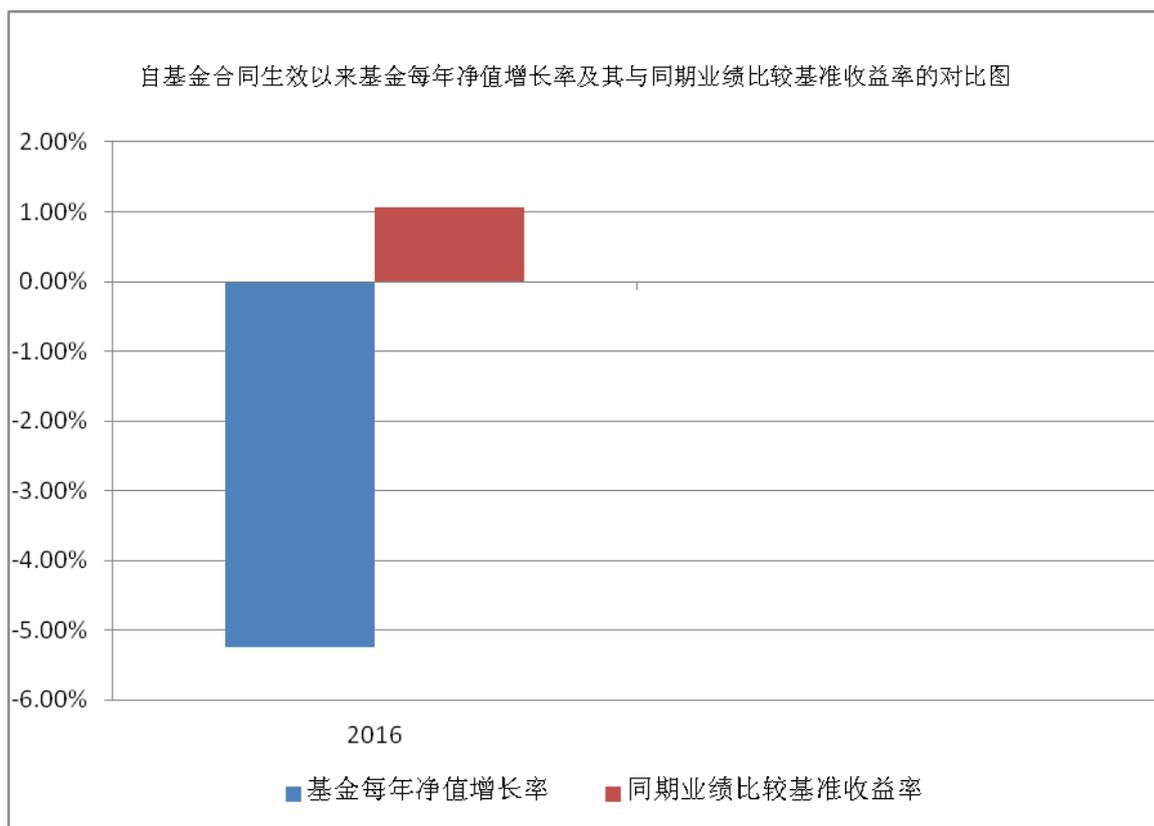
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.78%	0.89%	-0.98%	0.46%	-0.80%	0.43%
过去六个月	-10.21%	1.05%	-0.05%	0.49%	-10.16%	0.56%
自基金合同 生效起至今	-5.25%	1.71%	1.06%	0.63%	-6.31%	1.08%

### 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



### 3.2.3 自基金转型以来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



## 3.2 基金净值表现（转型前）

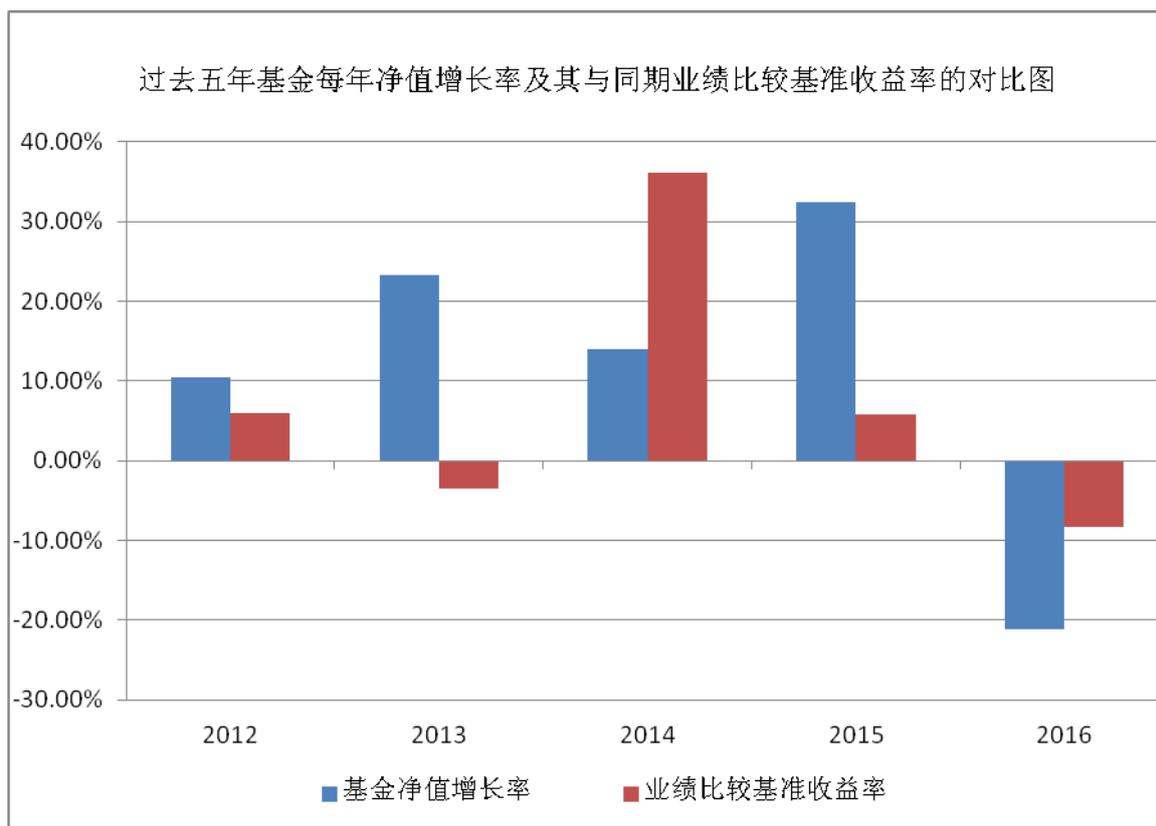
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	-12.87%	2.84%	-3.78%	1.57%	-9.09%	1.27%
过去六个月	4.33%	2.72%	2.98%	1.44%	1.35%	1.28%
过去一年	-22.04%	3.11%	-13.11%	1.91%	-8.93%	1.20%
过去三年	32.70%	2.31%	22.46%	1.34%	10.24%	0.97%
过去五年	8.25%	2.01%	6.99%	1.18%	1.26%	0.83%
自基金合同生效起至今	57.50%	1.85%	1.39%	1.30%	56.11%	0.55%

### 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



### 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



### 3.3 其他指标

注：无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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——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、天治财富增长证券投资基金、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、2004 年 6 月 29 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(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		
胡耀文	本基金基金经理	2015 年 6 月 3 日	-	6	金融学硕士研究生,具有基金从业资格。2010 年 2 月至 2013 年 9 月就职于东方证券股份有限公司任高级研究员,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。

#### 4.1.2 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		
胡耀文	本基金基金经理	2015 年 6 月 3 日	-	6	金融学硕士研究生,具有基金从业资格。2010 年 2 月至 2013 年 9 月就职于东方证券股份有限公司任高级研究员,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。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内,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

《天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》、《天治创新先锋混合型证券投资基金基金合同》、《天治创新先锋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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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。

#### 4.4.3 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。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾全年整个市场的风险偏好持续谨慎，一季度本基金虽然在熔断暴跌前及时降低仓位获得不错的相对收益，但在成长股和周期股的切换中却没有踩准节奏。一季度末创新先锋基金成功转型为中国制造 2025 行业细分基金，仓位灵活度有了很大改善。二季度是市场风险偏好最高的一个季度也是成长股表现最佳的时期，OLED、新材料和新能源汽车的三元趋势在二级市场持续表现，把握住两条主线本基金获得较好的绝对和相对收益。经过深入调研新能源汽车产业链，本基金在三季度集中持有相关产业链上游企业，布局实业已经达成共识的年底抢装行情。第三季度的配置造成基金净值的较大回撤，在行业预期不断抬升的时期没能获利反而强化预期重仓个股是今年操作

中值得反省的失误。本基金也深刻吸取本次教训，不能太过信任政策可持续性 & 产业预期。四季度，宏观预期发生很大改变以煤炭为首的周期品基本面持续超预期，地产周期顺利向中游转移。“煤飞色舞”行情叠加保险举牌效应，蓝筹股活跃度提升市场人气活跃度提升。本基金在策略上坚持看好轨道交通产业链，也配置 20% 周期品，但由于配置中成长股占比较高也没能跑赢指数。12 月本基金对明年宏观经济的持续看好并没有减仓控制回撤，也低估债市危机带来的流动性冲击。总体而言，本基金对行业配置还是以小盘成长股为主，在今年的市场风格下很难获得超额收益，甚至成为市场抛弃的重点。

本基金还将坚持自身风格寻找更多被低估的成长股，更加注重控制投资组合的风险。为投资者取得更好的投资回报。

#### 4.5.2 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 7 日-2016 年 6 月 30 日），本基金份额净值为 1.4923 元，报告期内本基金份额净值增长率为-5.25%，业绩比较基准收益率为 1.06%，低于同期业绩比较基准收益率 6.31%。

截至转型前报告期末（2016 年 4 月 6 日），本基金份额净值为 1.5750 元，报告期末六个月内本基金份额净值增长率为 4.33%，业绩比较基准收益率为 2.98%，高于同期业绩比较基准收益率 1.35%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年，宏观经济尤其是上半年还将运行在较为理想的水平，钢铁、化工、机械等周期性行业的资产负债表持续改善。所以伴随行业景气度保持高位，上半年周期行业龙头公司的估值还将出现稳步上移。但整个过程需要数据的不断确认，国内经济运行预期也将相对稳定。

2017 年，通胀预期虽然较高，但由于农产业去库存还没完成所以 CPI 压力并不大。原油价格带来输入型通胀的风险值得关注。

2017 年，新股发行节奏依然会保持较快水平，这将继续持续压制中小创板块的估值中枢。同时，再融资和外延并购事件会明显减少、进展也会较为缓慢。中小创公司的业绩成长也会出现很大压力。

2017 年，互联网红利效应会持续减弱，但与实体的融会将会明显增加。新的商业模式可能会出现亮点。

2017 年，供给侧改革和国企改革是政府工作重点，军工行业有望成为中国制造 2025 的重点领域，或将引领中国制造业的转型升级。

本基金在注重挖掘具备长期投资的成长股的同时，也会围绕传统龙头行业进行波段操作，争取为投资者贡献更好的回报。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未进行收益分配，符合相关法律法规和基金合同的约定。

#### 4.10 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

本基金报告期内存在连续 60 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 7 日至 2016 年 12 月 31 日。本基金管理人已于 2016 年 7 月 4 日向中国证监会报告了相关事宜及解决方案。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

报告期内，基金托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关

法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# § 6 审计报告（转型后）

## 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_B05 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	天治中国制造 2025 灵活配置混合型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中国制造 2025 灵活配置混合型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 4 月 7 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益（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	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

	<p>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，公允反映了天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 4 月 7 日至 2016 年 12 月 31 日止期间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

## § 6 审计报告（转型前）

### 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_B12 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	天治创新先锋混合型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创新先锋混合型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 4 月 6 日的资产负债表和 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 6 日止期间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，公允反映了天治创新先锋混合型证券投资基金 2016 年 4 月 6 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 6 日止期间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（转型后）

### 7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	7,176,479.34
结算备付金		8,127,714.14
存出保证金		87,636.39

交易性金融资产	7.4.7.2	17,913,250.00
其中：股票投资		17,913,250.00
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	7,474.09
应收股利		-
应收申购款		8,499.62
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		35,321,053.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		7,352.41
应付管理人报酬		44,719.06
应付托管费		7,453.16
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	539,950.34
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	457,349.72
负债合计		1,056,824.69
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	22,960,617.70
未分配利润	7.4.7.10	11,303,611.19
所有者权益合计		34,264,228.89
负债和所有者权益总计		35,321,053.58

注：（1）报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4923 元，基金份额总额 22,960,617.70 份。

（2）本基金由天治创新先锋混合型证券投资基金转型而成，转型日为 2016 年 4 月 7 日。

## 7.2 利润表

会计主体：天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2016 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-68,858.61
1. 利息收入		117,595.71
其中：存款利息收入	7.4.7.11	113,446.53
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		4,149.18
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,477,805.95
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,485,427.59
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-74,960.00
股利收益	7.4.7.16	67,338.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-2,675,686.72
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	11,426.45
<b>减：二、费用</b>		1,798,133.95
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	414,851.16
2. 托管费	7.4.10.2.2	69,141.83
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,125,555.64
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	188,585.32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,866,992.56
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,866,992.56



决议生效的公告》及《天治基金管理有限公司关于天治创新先锋混合型证券投资基金名称变更的公告》，本基金基金份额持有人大会于 2016 年 4 月 7 日表决通过了《关于天治创新先锋混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。自该日起，天治创新先锋混合型证券投资基金正式更名为天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金，其投资目标、投资范围、投资策略、收益分配方式等内容进行相应修订，原《天治创新混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金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，投资于受益于中国制造 2025 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：申银万国制造业指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

#### 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 4 月 7 日至 2016 年 12 月 31 日止期间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。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2016 年 4 月 7 日至 2016 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效

套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 股指期货

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

#### (5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (6) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### (1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

#### (2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发

行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 权证投资收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红

利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	7,176,479.34
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,176,479.34

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	19,253,183.77	17,913,250.00	-1,339,933.77
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	19,253,183.77	17,913,250.00	-1,339,933.77

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应收活期存款利息	155.34
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	5,980.02
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	1,299.18
应收申购款利息	0.15
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	39.40
合计	7,474.09

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	539,950.34
银行间市场应付交易费用	-
合计	539,950.34

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	27.71
其他	7,322.01
预提审计费	50,000.00
预提信息披露费	150,000.00
合计	457,349.72

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年4月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	24,102,991.31	24,102,991.31
本期申购	6,466,311.30	6,466,311.30
本期赎回(以“-”号填列)	-7,608,684.91	-7,608,684.91
- 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	22,960,617.70	22,960,617.70

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**7.4.7.10 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	17,970,579.86	-4,110,307.09	13,860,272.77
本期利润	808,694.16	-2,675,686.72	-1,866,992.56
本期基金份额交易产生的变动数	-828,864.59	139,195.57	-689,669.02
其中：基金申购款	5,311,469.93	-1,488,933.11	3,822,536.82
基金赎回款	-6,140,334.52	1,628,128.68	-4,512,205.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,950,409.43	-6,646,798.24	11,303,611.19

**7.4.7.11 存款利息收入**

项目	本期 2016年4月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	7,775.54
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	104,193.07
其他	1,477.92
合计	113,446.53

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 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7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	375,288,930.28
减：卖出股票成本总额	372,803,502.69
买卖股票差价收入	2,485,427.59

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无债券投资收益。

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期无——买卖债券差价收入。

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无——赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无——申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2016年4月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股指期货-投资收益	-74,960.00

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	67,338.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	67,338.36

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年4月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-2,675,686.72
——股票投资	-2,675,686.72
——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	-2,675,686.72

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	10,803.04
转换费收入	623.41
合计	11,426.45

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月7日(基金合同生效日)至2016年
----	--------------------------------

	12月31日
交易所市场交易费用	1,125,555.64
银行间市场交易费用	-
合计	1,125,555.64

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月7日(基金合同生效日)至2016 年12月31日
审计费用	36,748.83
信息披露费	110,246.49
其他	40,000.00
账户维护费	1,500.00
银行汇划费用	90.00
合计	188,585.32

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 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
交通银行股份有限公司	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
天治资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

##### 7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.9.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 7.4.9.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.9.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 7.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.9.1.5 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无通过关联方交易单元进行的应支付关联方的佣金。

### 7.4.9.2 关联方报酬

#### 7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年4月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期应支付的管理费	414,851.16
其中：支付销售机构的客户维护费	104,188.16

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，基金托管人复核后于次月首日起15个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年4月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期应支付的托管费	69,141.83

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首日起 15 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

#### 7.4.9.2.3 销售服务费

注：无

#### 7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.9.4.1 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末运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.9.4.2 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未投资本基金。

#### 7.4.9.5 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7日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	7,176,479.34	7,775.54

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。另外，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2016 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

#### 7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10 利润分配情况

##### 7.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期末进行利润分配。

### 7.4.11 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

#### 7.4.11.2 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 11 月 28 日	筹划重大事项	16.61	2017 年 1 月 12 日	20.22	100,000	1,968,126.00	1,661,000.00	
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	筹划重大事项	14.66	-	-	100,000	1,493,978.09	1,466,000.00	

#### 7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.11.3.1 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。

##### 7.4.11.3.2 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。

### 7.4.12 金融工具风险及管理

#### 7.4.12.1 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。

#### 7.4.12.2 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。

#### **15.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无

#### **15.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无

#### **7.4.12.3 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 7.4.12 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。

#### **7.4.12.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无

#### **7.4.12.4 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。

#### 7.4.12.4.1 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。

##### 7.4.12.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2016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	7,176,479.34	-	-	-	-	-	7,176,479.34
结算备付金	8,127,714.14	-	-	-	-	-	8,127,714.14
存出保证金	87,636.39	-	-	-	-	-	87,636.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-	17,913,250.00	17,913,250.00
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	-	-	2,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	7,474.09	7,474.09
应收申购款	3,578.53	-	-	-	-	4,921.09	8,499.62
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	17,395,408.40	-	-	-	-	17,925,645.18	35,321,053.58
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,352.41	7,352.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	44,719.06	44,719.06
应付托管费	-	-	-	-	-	7,453.16	7,453.16
应付交易费用	-	-	-	-	-	539,950.34	539,950.34
其他负债	-	-	-	-	-	457,349.72	457,349.72
负债总计	-	-	-	-	-	1,056,824.69	1,056,824.69
利率敏感度缺口	17,395,408.40	-	-	-	-	-16,868,820.49	34,264,228.89

##### 7.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期末与上年度末均未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.12.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.12.4.3 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。

#### 7.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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	17,913,250.00	52.28
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	17,913,250.00	52.28

#### 7.4.12.4.3.2 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12月31日）
	业绩比较基准变动-5%	-2,795,123.93
	业绩比较基准变动+5%	2,795,123.93

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

#### 7.4.13 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 14,786,250.00 元,属于第二层次的余额为人民币 3,127,000.00 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。

## § 7 年度财务报表 (转型前)

### 7.1 资产负债表 (转型前)

会计主体:天治创新先锋

报告截止日:2016 年 4 月 6 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 4 月 6 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,041,014.97	7,100,964.34
结算备付金		4,831,725.25	2,252,328.07
存出保证金		144,236.27	133,264.74
交易性金融资产	7.4.7.2	34,080,510.00	39,281,559.00
其中:股票投资		34,080,510.00	39,281,559.00
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,980,500.38
应收利息	7.4.7.5	6,501.83	2,430.31
应收股利		-	-
应收申购款		43,968.21	17,160.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		40,147,956.53	50,768,207.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年4月6日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,036,510.55	2,665,112.46
应付赎回款		125,488.06	61,098.88
应付管理人报酬		9,079.06	55,207.22
应付托管费		1,513.18	9,201.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	641,542.96	349,606.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	370,558.64	557,548.41
负债合计		2,184,692.45	3,697,774.54
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	24,102,991.31	23,584,005.53
未分配利润	7.4.7.10	13,860,272.77	23,486,427.67
所有者权益合计		37,963,264.08	47,070,433.20
负债和所有者权益总计		40,147,956.53	50,768,207.74

注：1、报告截止日 2016 年 4 月 6 日，基金份额净值 1.5750 元，基金份额总额 24,102,991.31 份。

2、本基金自 2016 年 4 月 7 日起转型为天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金。

## 7.2 利润表

会计主体：天治创新先锋

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 6 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 6 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-8,893,034.54	34,992,142.36
1. 利息收入		45,095.95	136,126.90
其中：存款利息收入	7.4.7.11	44,523.73	136,126.90
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		572.22	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,695,430.80	46,023,657.88
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-9,695,430.80	45,684,688.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	338,969.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	711,847.43	-11,281,040.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	45,452.88	113,398.05
<b>减：二、费用</b>		722,761.13	3,775,083.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	152,548.69	952,064.59
2. 托管费	7.4.10.2.2	25,424.81	158,677.35
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	477,037.95	2,355,921.93
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	67,749.68	308,420.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-9,615,795.67	31,217,058.49
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-9,615,795.67	31,217,058.49

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治创新先锋

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 6 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 6 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）	23,584,005.53	23,486,427.67	47,070,433.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,615,795.67	-9,615,795.67
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）	518,985.78	-10,359.23	508,626.55
其中：1. 基金申购款	26,754,201.98	10,982,965.20	37,737,167.18
2. 基金赎回款	-26,235,216.20	-10,993,324.43	-37,228,540.63
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）	24,102,991.31	13,860,272.77	37,963,264.08
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）	70,428,918.24	35,692,620.84	106,121,539.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,217,058.49	31,217,058.49
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）	-46,844,912.71	-43,423,251.66	-90,268,164.37
其中：1. 基金申购款	46,073,392.51	51,784,291.28	97,857,683.79
2. 基金赎回款	-92,918,305.22	-95,207,542.94	-188,125,848.16
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）	23,584,005.53	23,486,427.67	47,070,433.20

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

天治创新先锋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”）证监许可[2008]297号文《关于核准天治创新先锋股票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募集，基金合同于2008年5月8日正式生效，首次设立募集规模为248,496,003.92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，基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金于2015年8月4日起更名为天治创新先锋混合型证券投资基金。

根据《天治基金管理有限公司关于天治创新先锋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》及《天治基金管理有限公司关于天治创新先锋混合型证券投资基金名称变更的公告》，本基金基金份额持有人大会于2016年4月7日表决通过了《关于天治创新先锋混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。自该日起，本基金正式更名为天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金，其投资目标、投资范围、投资策略、收益分配方式等内容进行相应修订，原《天治创新混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、可转债、央行票据、短期融资券、回购、权证、资产支持证券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

### 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。

根据《天治基金管理有限公司关于天治创新先锋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》及《天治基金管理有限公司关于天治创新先锋混合型证券投资基金名称变更的公告》，本基金于 2016 年 4 月 7 日起转型为天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金继续运作，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

### 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 4 月 6 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 6 日止期间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。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 6 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (4) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### (1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

#### (2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式(指将现金红利按分红权益再投资日经过除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资),基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式,基金份额持有人事先未作出选择的,默认的分红方式为现金红利;

(2) 每一基金份额享有同等分配权;

(3) 基金当期收益先弥补前期亏损后,方可进行当期收益分配;

(4) 基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值;

(5) 如果基金当期出现亏损,则不进行收益分配;

(6) 在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至多 6 次;

(7) 每次基金收益分配比例不得低于可分配收益的 50%。基金合同生效不满 3 个月,收益可不分配;

(8) 分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红,分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红;

(9) 法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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。

#### 7.4.6.2 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。

#### 7.4.6.3 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 4 月 6 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	1,041,014.97	7,100,964.34
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,041,014.97	7,100,964.34

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 4 月 6 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	32,744,757.05	34,080,510.00	1,335,752.95
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	32,744,757.05	34,080,510.00	1,335,752.95
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	38,657,653.48	39,281,559.00	623,905.52
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	38,657,653.48	39,281,559.00	623,905.52

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年4月6日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	1,140.39	446.68
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	5,253.33	1,823.50
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.37	100.23
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	107.74	59.90
合计	6,501.83	2,430.31

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年4月6日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	641,542.96	349,606.39
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	641,542.96	349,606.39

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年4月6日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	231.95	226.40
其他	7,322.01	7,322.01
预提审计费	73,251.17	60,000.00
预提信息披露费	39,753.51	240,000.00
合计	370,558.64	557,548.41

## 7.4.7.9 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6日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,584,005.53	23,584,005.53
本期申购	26,754,201.98	26,754,201.98
本期赎回（以“-”号填列）	-26,235,216.20	-26,235,216.20
- 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	24,102,991.31	24,102,991.31

金额单位：人民币元

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 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	27,761,255.95	-4,274,828.28	23,486,427.67
本期利润	-10,327,643.10	711,847.43	-9,615,795.67
本期基金份额交易产生的变动数	536,967.01	-547,326.24	-10,359.23
其中：基金申购款	20,909,948.64	-9,926,983.44	10,982,965.20
基金赎回款	-20,372,981.63	9,379,657.20	-10,993,324.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,970,579.86	-4,110,307.09	13,860,272.77

**7.4.7.11 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 6日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
活期存款利息收入	8,344.50	23,909.94
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	34,856.29	109,299.39
其他	1,322.94	2,917.57
合计	44,523.73	136,126.90

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 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6日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
卖出股票成交总额	156,925,042.19	809,051,360.25
减：卖出股票成本总额	166,620,472.99	763,366,671.77
买卖股票差价收入	-9,695,430.80	45,684,688.48

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益——买卖债券差价收入。

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

**7.4.7.16 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6日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
股票投资产生的股利收益	-	338,969.40
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	-	338,969.40

**7.4.7.17 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6日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	711,847.43	-11,281,040.47

——股票投资	711,847.43	-11,281,040.47
——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	711,847.43	-11,281,040.47

#### 7.4.7.18 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 6日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
基金赎回费收入	45,115.15	90,841.03
转换费收入	337.73	22,557.02
合计	45,452.88	113,398.05

#### 7.4.7.19 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 6日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
交易所市场交易费用	477,037.95	2,355,921.93
银行间市场交易费用	-	-
合计	477,037.95	2,355,921.93

#### 7.4.7.20 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6日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
审计费用	13,251.17	50,000.00
信息披露费	39,753.51	240,000.00
其他	10,200.00	200.00
账户维护费	4,500.00	18,000.00
银行汇划费用	45.00	220.00
合计	67,749.68	308,420.00

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 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
交通银行股份有限公司	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
天治资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

### 7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.9.1.1 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股票交易。

#### 7.4.9.1.2 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债券交易。

#### 7.4.9.1.3 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回购交易。

#### 7.4.9.1.4 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权证交易。

#### 7.4.9.1.5 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无应支付关联方的佣金。

### 7.4.9.2 关联方报酬

#### 7.4.9.2.1 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	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31

	月 6 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	152,548.69	952,064.59
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	36,735.10	254,139.30

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首日起 15 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 7.4.9.2.2 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 4 月 6 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	25,424.81	158,677.35

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首日起 15 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

#### 7.4.9.2.3 销售服务费

注：无

#### 7.4.9.3 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。

#### 7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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固有资金投资本基金。

##### 7.4.9.4.2 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。

#### 7.4.9.5 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6日		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
交通银行股份有限公司	1,041,014.97	8,344.50	7,100,964.34	23,909.94

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。另外，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2016年12月31日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2015年12月31日：同）。

#### 7.4.9.6 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。

#### 7.4.10 利润分配情况

##### 7.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.11 期末（2016年4月6日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

##### 7.4.11.2 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
002730	电光科技	2016年3月30日	重大事项停牌	44.47	2016年4月12日	42.84	70,000	2,869,287.00	3,112,900.00	-
002612	朗姿股	2015年12	重大事项	63.54	2016年6	33.87	20,000	1,262,702.99	1,270,800.00	-

	份	月 22 日	停牌		月 20 日					
600446	金证股份	2016 年 4 月 6 日	重大事项停牌	38.98	2016 年 4 月 11 日	36.49	28,000	1,038,452.00	1,091,440.00	-
601689	拓普集团	2016 年 3 月 28 日	重大事项停牌	26.42	2016 年 4 月 12 日	29.00	39,000	1,047,246.00	1,030,380.00	-

### 7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 4 月 6 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。

#### 7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 4 月 6 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。

### 7.4.12 金融工具风险及管理

#### 7.4.12.1 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。

#### 7.4.12.2 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。

**17.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无

**17.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无

**7.4.12.3 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 7.4.12 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。

**7.4.12.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无

**7.4.12.4 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。

**7.4.12.4.1 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、存出保证金等。

**7.4.12.4.1.1 利率风险敞口**

金额单位：人民币元

本期末	1 个月以内	1-3 个	3 个月	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2016年4月6日		月	-1年				
资产							
银行存款	1,041,014.97	-	-	-	-	-	1,041,014.97
结算备付金	4,831,725.25	-	-	-	-	-	4,831,725.25
存出保证金	144,236.27	-	-	-	-	-	144,236.27
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-34,080,510.00	34,080,510.00
应收利息	-	-	-	-	-	6,501.83	6,501.83
应收申购款	4,473.18	-	-	-	-	39,495.03	43,968.21
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,021,449.67	-	-	-	-	-34,126,506.86	40,147,956.53
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,036,510.55	1,036,510.55
应付赎回款	-	-	-	-	-	125,488.06	125,488.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,079.06	9,079.06
应付托管费	-	-	-	-	-	1,513.18	1,513.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	641,542.96	641,542.96
其他负债	-	-	-	-	-	370,558.64	370,558.64
负债总计	-	-	-	-	-	2,184,692.45	2,184,692.45
利率敏感度缺口	6,021,449.67	-	-	-	-	-31,941,814.41	37,963,264.08
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	7,100,964.34	-	-	-	-	-	7,100,964.34
结算备付金	2,252,328.07	-	-	-	-	-	2,252,328.07
存出保证金	133,264.74	-	-	-	-	-	133,264.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-39,281,559.00	39,281,559.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,980,500.38	1,980,500.38
应收利息	-	-	-	-	-	2,430.31	2,430.31
应收申购款	-	-	-	-	-	17,160.90	17,160.90
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,486,557.15	-	-	-	-	-41,281,650.59	50,768,207.74
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,665,112.46	2,665,112.46
应付赎回款	-	-	-	-	-	61,098.88	61,098.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	55,207.22	55,207.22
应付托管费	-	-	-	-	-	9,201.18	9,201.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	349,606.39	349,606.39
其他负债	-	-	-	-	-	557,548.41	557,548.41
负债总计	-	-	-	-	-	3,697,774.54	3,697,774.54
利率敏感度缺口	9,486,557.15	-	-	-	-	-37,583,876.05	47,070,433.20

#### 7.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期末与上年度末均未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.12.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.12.4.3 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。

##### 7.4.12.4.3.1 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6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	34,080,510.00	89.77	39,281,559.00	83.45
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	34,080,510.00	89.77	39,281,559.00	83.45

##### 7.4.12.4.3.2 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6日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准变动-5%	-2,795,123.93	-3,124,319.37
	业绩比较基准变动+5%	2,795,123.93	3,124,319.37

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

#### 7.4.13 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 4 月 6 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 27,574,990.00 元，属于第二层次的余额为人民币 6,505,520.00 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 37,772,359.00 元，属于第二层次的余额为人民币 1,509,200.00 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

截止至资产负债表日，本基金无需要说明的重要事项。

##### 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（转型后）

### 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	17,913,250.00	50.72
	其中：股票	17,913,250.00	50.72
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	2,000,000.00	5.66
	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	15,304,193.48	43.33
7	其他各项资产	103,610.10	0.29
8	合计	35,321,053.58	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	1,908,350.00	5.57
B	采矿业	1,442,500.00	4.21
C	制造业	10,577,400.00	30.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	644,700.00	1.88
E	建筑业	984,300.00	2.87
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	695,000.00	2.03
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	4.85
S	综合	-	-
	合计	17,913,250.00	52.28

### 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：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 8.3 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	300351	永贵电器	100,000	2,567,000.00	7.49
2	300011	鼎汉技术	110,000	2,279,200.00	6.65
3	600576	万家文化	100,000	1,661,000.00	4.85
4	300088	长信科技	100,000	1,466,000.00	4.28
5	000998	隆平高科	45,000	964,350.00	2.81
6	002041	登海种业	50,000	944,000.00	2.76
7	000930	中粮生化	70,000	940,800.00	2.75
8	000528	柳工	120,000	877,200.00	2.56
9	600497	驰宏锌锗	100,000	703,000.00	2.05
10	000069	华侨城 A	100,000	695,000.00	2.03
11	000807	云铝股份	100,000	670,000.00	1.96
12	000407	胜利股份	70,000	644,700.00	1.88
13	000059	华锦股份	50,000	595,000.00	1.74
14	000928	中钢国际	30,000	525,900.00	1.53
15	000008	神州高铁	50,000	466,000.00	1.36
16	002051	中工国际	20,000	458,400.00	1.34
17	601699	潞安环能	50,000	402,500.00	1.17
18	000708	大冶特钢	30,000	382,200.00	1.12
19	000937	冀中能源	50,000	337,000.00	0.98

20	600782	新钢股份	100,000	334,000.00	0.97
----	--------	------	---------	------------	------

## 8.2 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.2.1 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	002730	电光科技	7,407,683.30	21.62
2	002460	赣锋锂业	6,150,628.26	17.95
3	002466	天齐锂业	5,943,010.00	17.34
4	600869	智慧能源	5,922,376.00	17.28
5	300014	亿纬锂能	5,797,986.92	16.92
6	002245	澳洋顺昌	5,387,092.90	15.72
7	300153	科泰电源	4,737,140.00	13.83
8	601390	中国中铁	4,454,237.00	13.00
9	603026	石大胜华	4,426,310.00	12.92
10	300409	道氏技术	4,351,097.10	12.70
11	300161	华中数控	4,172,867.00	12.18
12	601186	中国铁建	4,108,055.72	11.99
13	300444	双杰电气	3,689,653.54	10.77
14	300198	纳川股份	3,511,515.56	10.25
15	600884	杉杉股份	3,246,816.00	9.48
16	300097	智云股份	3,230,275.00	9.43
17	002341	新纶科技	3,215,958.88	9.39
18	300011	鼎汉技术	3,187,919.00	9.30
19	002407	多氟多	3,100,800.00	9.05
20	600777	新潮能源	3,059,954.00	8.93
21	600497	驰宏锌锗	3,051,434.00	8.91
22	002340	格林美	3,030,510.40	8.84
23	300144	宋城演艺	2,902,985.00	8.47
24	600172	黄河旋风	2,834,196.48	8.27
25	300351	永贵电器	2,827,955.60	8.25
26	300088	长信科技	2,659,281.00	7.76
27	300083	劲胜精密	2,642,698.00	7.71
28	002074	国轩高科	2,405,714.90	7.02

29	300100	双林股份	2,306,518.00	6.73
30	002426	胜利精密	2,278,421.00	6.65
31	002357	富临运业	2,250,449.43	6.57
32	300278	华昌达	2,248,610.17	6.56
33	600547	山东黄金	2,233,196.00	6.52
34	002355	兴民智通	2,210,234.00	6.45
35	603993	洛阳钼业	2,209,705.00	6.45
36	002092	中泰化学	2,205,407.27	6.44
37	300397	天和防务	2,199,882.72	6.42
38	002076	雪莱特	2,182,607.00	6.37
39	000425	徐工机械	2,179,792.35	6.36
40	000878	云南铜业	2,178,763.00	6.36
41	002165	红宝丽	2,174,122.04	6.35
42	300491	通合科技	2,173,748.00	6.34
43	002475	立讯精密	2,168,777.89	6.33
44	300012	华测检测	2,166,054.42	6.32
45	600988	赤峰黄金	2,164,635.00	6.32
46	300136	信维通信	2,160,449.52	6.31
47	600860	京城股份	2,157,591.00	6.30
48	002456	欧菲光	2,153,605.00	6.29
49	601668	中国建筑	2,151,200.00	6.28
50	002548	金新农	2,150,079.00	6.27
51	601800	中国交建	2,147,064.00	6.27
52	300499	高澜股份	2,142,689.00	6.25
53	600576	万家文化	2,141,726.00	6.25
54	600489	中金黄金	2,125,562.00	6.20
55	300210	森远股份	2,122,089.09	6.19
56	000758	中色股份	2,108,586.00	6.15
57	002284	亚太股份	2,106,881.00	6.15
58	601198	东兴证券	2,103,500.00	6.14
59	000823	超声电子	2,101,419.00	6.13
60	002155	湖南黄金	2,097,363.25	6.12
61	002111	威海广泰	2,078,454.35	6.07
62	000060	中金岭南	2,073,043.00	6.05
63	600362	江西铜业	2,070,640.00	6.04
64	300115	长盈精密	2,016,497.62	5.89

65	002488	金固股份	2,011,374.00	5.87
66	300228	富瑞特装	1,998,340.00	5.83
67	601699	潞安环能	1,975,919.80	5.77
68	600310	桂东电力	1,928,113.00	5.63
69	002405	四维图新	1,888,597.00	5.51
70	600348	阳泉煤业	1,855,833.00	5.42
71	002684	猛狮科技	1,851,641.50	5.40
72	000937	冀中能源	1,847,087.00	5.39
73	300033	同花顺	1,807,973.00	5.28
74	000558	莱茵体育	1,762,222.00	5.14
75	600562	国睿科技	1,755,136.00	5.12
76	000807	云铝股份	1,571,998.00	4.59
77	002077	大港股份	1,539,092.43	4.49
78	002618	丹邦科技	1,402,285.00	4.09
79	300486	东杰智能	1,342,851.50	3.92
80	002008	大族激光	1,307,350.00	3.82
81	603799	华友钴业	1,293,955.00	3.78
82	002055	得润电子	1,240,399.60	3.62
83	600730	中国高科	1,223,391.75	3.57
84	300095	华伍股份	1,210,150.00	3.53
85	002537	海立美达	1,204,880.71	3.52
86	300420	五洋科技	1,199,486.00	3.50
87	002659	中泰桥梁	1,199,434.00	3.50
88	002056	横店东磁	1,183,558.55	3.45
89	002594	比亚迪	1,181,500.00	3.45
90	601777	力帆股份	1,177,658.00	3.44
91	600711	盛屯矿业	1,161,601.00	3.39
92	601311	骆驼股份	1,155,419.61	3.37
93	000789	万年青	1,151,674.39	3.36
94	002226	江南化工	1,147,841.00	3.35
95	600303	曙光股份	1,146,836.50	3.35
96	300224	正海磁材	1,142,163.00	3.33
97	002709	天赐材料	1,139,079.00	3.32
98	002353	杰瑞股份	1,134,734.76	3.31
99	300477	合纵科技	1,130,959.00	3.30
100	300078	思创医惠	1,129,738.10	3.30

101	002698	博实股份	1,125,860.16	3.29
102	000526	紫光学大	1,125,393.80	3.28
103	300461	田中精机	1,124,192.00	3.28
104	300470	日机密封	1,120,412.00	3.27
105	000700	模塑科技	1,120,081.14	3.27
106	002273	水晶光电	1,118,360.44	3.26
107	600491	龙元建设	1,118,169.99	3.26
108	300367	东方网力	1,118,097.10	3.26
109	002188	巴士在线	1,115,649.00	3.26
110	002158	汉钟精机	1,113,834.00	3.25
111	601766	中国中车	1,113,240.00	3.25
112	600502	安徽水利	1,112,407.00	3.25
113	600169	太原重工	1,112,169.00	3.25
114	603588	高能环境	1,111,868.07	3.24
115	000877	天山股份	1,109,003.95	3.24
116	300058	蓝色光标	1,109,000.00	3.24
117	000928	中钢国际	1,108,064.00	3.23
118	000601	韶能股份	1,106,027.00	3.23
119	600123	兰花科创	1,104,980.00	3.22
120	002142	宁波银行	1,104,503.30	3.22
121	000826	启迪桑德	1,102,867.00	3.22
122	002636	金安国纪	1,100,573.00	3.21
123	300252	金信诺	1,099,326.23	3.21
124	603989	艾华集团	1,096,785.00	3.20
125	300141	和顺电气	1,094,161.00	3.19
126	000630	铜陵有色	1,093,409.85	3.19
127	600900	长江电力	1,092,070.00	3.19
128	600674	川投能源	1,091,891.50	3.19
129	601001	大同煤业	1,090,427.90	3.18
130	601799	星宇股份	1,084,750.42	3.17
131	000750	国海证券	1,082,700.00	3.16
132	002518	科士达	1,080,464.00	3.15
133	002364	中恒电气	1,080,017.00	3.15
134	000876	新希望	1,075,750.00	3.14
135	002635	安洁科技	1,075,504.00	3.14
136	600081	东风科技	1,075,330.78	3.14

137	603686	龙马环卫	1,073,822.86	3.13
138	601939	建设银行	1,073,500.00	3.13
139	601169	北京银行	1,073,061.00	3.13
140	603609	禾丰牧业	1,072,795.50	3.13
141	002668	奥马电器	1,070,097.57	3.12
142	601009	南京银行	1,068,018.00	3.12
143	002455	百川股份	1,067,071.27	3.11
144	600584	长电科技	1,066,766.00	3.11
145	603328	依顿电子	1,064,442.00	3.11
146	601002	晋亿实业	1,064,007.00	3.11
147	600061	国投安信	1,063,960.00	3.11
148	000801	四川九洲	1,063,816.00	3.10
149	000531	穗恒运 A	1,063,620.00	3.10
150	600110	诺德股份	1,062,700.00	3.10
151	600990	四创电子	1,059,918.00	3.09
152	600188	兖州煤业	1,059,220.02	3.09
153	002480	新筑股份	1,056,941.00	3.08
154	002229	鸿博股份	1,053,934.00	3.08
155	600236	桂冠电力	1,051,959.00	3.07
156	002190	成飞集成	1,050,971.00	3.07
157	002097	山河智能	1,048,478.00	3.06
158	300346	南大光电	1,047,909.00	3.06
159	300349	金卡股份	1,047,435.00	3.06
160	601398	工商银行	1,046,500.00	3.05
161	002385	大北农	1,046,085.00	3.05
162	603066	音飞储存	1,045,897.00	3.05
163	600508	上海能源	1,045,536.00	3.05
164	300545	联得装备	1,044,984.00	3.05
165	002449	国星光电	1,044,654.00	3.05
166	601788	光大证券	1,041,124.18	3.04
167	002125	湘潭电化	1,040,853.00	3.04
168	600066	宇通客车	1,039,005.00	3.03
169	002501	利源精制	1,037,283.00	3.03
170	002413	雷科防务	1,036,288.90	3.02
171	002519	银河电子	1,034,590.00	3.02
172	002311	海大集团	1,032,729.00	3.01

173	002241	歌尔股份	1,027,314.00	3.00
174	600741	华域汽车	1,025,955.00	2.99
175	600395	盘江股份	1,025,054.00	2.99
176	002036	联创电子	1,022,570.00	2.98
177	603901	永创智能	1,020,823.80	2.98
178	000967	盈峰环境	1,020,412.00	2.98
179	600068	葛洲坝	1,017,800.00	2.97
180	000983	西山煤电	1,016,419.00	2.97
181	600997	开滦股份	1,016,070.00	2.97
182	300021	大禹节水	1,011,473.00	2.95
183	002062	宏润建设	1,009,715.00	2.95
184	000998	隆平高科	1,009,413.00	2.95
185	300056	三维丝	1,008,348.00	2.94
186	002051	中工国际	1,005,835.00	2.94
187	601069	西部黄金	1,001,903.09	2.92
188	600104	上汽集团	995,997.15	2.91
189	002041	登海种业	992,766.00	2.90
190	000930	中粮生化	984,632.00	2.87
191	000528	柳工	977,987.49	2.85
192	601288	农业银行	969,000.00	2.83
193	300173	智慧松德	966,119.00	2.82
194	300203	聚光科技	961,542.00	2.81
195	002643	万润股份	959,661.00	2.80
196	600598	北大荒	947,537.00	2.77
197	300373	扬杰科技	936,192.80	2.73
198	600158	中体产业	936,052.00	2.73
199	300230	永利股份	929,341.00	2.71
200	600596	新安股份	925,020.00	2.70
201	300309	吉艾科技	883,995.00	2.58
202	600478	科力远	825,411.00	2.41
203	600837	海通证券	821,762.00	2.40
204	600048	保利地产	804,136.00	2.35
205	600820	隧道股份	796,800.00	2.33
206	000069	华侨城 A	748,045.00	2.18

## 8.2.2 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	002730	电光科技	10,453,897.80	30.51
2	002460	赣锋锂业	5,856,010.12	17.09
3	600869	智慧能源	5,772,443.00	16.85
4	300083	劲胜精密	5,598,047.12	16.34
5	002466	天齐锂业	5,561,409.00	16.23
6	300014	亿纬锂能	5,455,128.00	15.92
7	300198	纳川股份	5,343,003.70	15.59
8	300153	科泰电源	5,048,167.00	14.73
9	002245	澳洋顺昌	4,954,603.30	14.46
10	300161	华中数控	4,481,874.00	13.08
11	601390	中国中铁	4,431,881.50	12.93
12	300409	道氏技术	4,172,414.72	12.18
13	603026	石大胜华	4,139,589.17	12.08
14	601186	中国铁建	4,114,519.14	12.01
15	300444	双杰电气	4,061,377.00	11.85
16	600547	山东黄金	3,553,659.00	10.37
17	300097	智云股份	3,477,788.65	10.15
18	002548	金新农	3,461,871.67	10.10
19	600988	赤峰黄金	3,422,363.00	9.99
20	600489	中金黄金	3,417,575.00	9.97
21	600884	杉杉股份	3,150,369.86	9.19
22	002341	新纶科技	3,143,500.80	9.17
23	300144	宋城演艺	2,897,620.07	8.46
24	300033	同花顺	2,896,153.38	8.45
25	600777	新潮能源	2,837,854.00	8.28
26	600172	黄河旋风	2,833,240.00	8.27
27	002340	格林美	2,786,677.00	8.13
28	002407	多氟多	2,725,576.00	7.95
29	600497	驰宏锌锗	2,693,100.00	7.86
30	300397	天和防务	2,618,829.50	7.64
31	600576	万家文化	2,539,171.70	7.41
32	300100	双林股份	2,449,526.55	7.15
33	300499	高澜股份	2,424,314.00	7.08
34	300278	华昌达	2,368,552.07	6.91

35	002357	富临运业	2,357,741.40	6.88
36	002076	雪莱特	2,343,094.57	6.84
37	300136	信维通信	2,342,933.41	6.84
38	300491	通合科技	2,334,700.00	6.81
39	000060	中金岭南	2,326,004.00	6.79
40	002475	立讯精密	2,295,029.14	6.70
41	601800	中国交建	2,262,273.00	6.60
42	002284	亚太股份	2,261,663.00	6.60
43	002155	湖南黄金	2,250,082.00	6.57
44	601668	中国建筑	2,232,000.00	6.51
45	002165	红宝丽	2,217,313.00	6.47
46	300012	华测检测	2,206,100.06	6.44
47	603993	洛阳钼业	2,194,400.00	6.40
48	002092	中泰化学	2,194,071.26	6.40
49	000425	徐工机械	2,158,200.00	6.30
50	601069	西部黄金	2,157,719.00	6.30
51	002426	胜利精密	2,150,278.96	6.28
52	002456	欧菲光	2,149,524.00	6.27
53	600860	京城股份	2,141,565.00	6.25
54	002074	国轩高科	2,131,407.00	6.22
55	601198	东兴证券	2,102,508.04	6.14
56	002111	威海广泰	2,087,603.07	6.09
57	000878	云南铜业	2,072,500.00	6.05
58	000758	中色股份	2,064,048.00	6.02
59	002355	兴民智通	2,059,866.00	6.01
60	300210	森远股份	2,032,664.00	5.93
61	000823	超声电子	2,018,013.53	5.89
62	601777	力帆股份	2,006,741.00	5.86
63	600475	华光股份	1,991,749.92	5.81
64	600348	阳泉煤业	1,933,300.00	5.64
65	600362	江西铜业	1,926,500.00	5.62
66	300115	长盈精密	1,919,613.19	5.60
67	300228	富瑞特装	1,913,874.68	5.59
68	002405	四维图新	1,903,646.60	5.56
69	002684	猛狮科技	1,902,199.12	5.55
70	600562	国睿科技	1,817,378.65	5.30
71	002488	金固股份	1,801,036.00	5.26
72	000558	莱茵体育	1,754,764.01	5.12

73	600310	桂东电力	1,735,343.42	5.06
74	300059	东方财富	1,661,164.00	4.85
75	600136	当代明诚	1,633,399.00	4.77
76	002077	大港股份	1,629,971.28	4.76
77	601699	潞安环能	1,623,410.00	4.74
78	000937	冀中能源	1,550,916.18	4.53
79	002618	丹邦科技	1,460,371.12	4.26
80	002590	万安科技	1,446,843.00	4.22
81	300486	东杰智能	1,364,534.00	3.98
82	600110	诺德股份	1,345,480.24	3.93
83	002188	巴士在线	1,326,203.58	3.87
84	300088	长信科技	1,326,000.00	3.87
85	002537	海立美达	1,321,009.98	3.86
86	002455	百川股份	1,314,987.26	3.84
87	600303	曙光股份	1,306,379.00	3.81
88	002008	大族激光	1,264,173.00	3.69
89	300420	五洋科技	1,256,314.00	3.67
90	000630	铜陵有色	1,254,000.00	3.66
91	002055	得润电子	1,252,904.00	3.66
92	300095	华伍股份	1,246,701.64	3.64
93	002097	山河智能	1,226,695.00	3.58
94	002594	比亚迪	1,214,132.00	3.54
95	603989	艾华集团	1,213,516.00	3.54
96	600730	中国高科	1,210,500.00	3.53
97	002659	中泰桥梁	1,204,451.00	3.52
98	601311	骆驼股份	1,183,609.84	3.45
99	300346	南大光电	1,183,520.00	3.45
100	601001	大同煤业	1,179,049.00	3.44
101	601766	中国中车	1,177,719.00	3.44
102	603588	高能环境	1,175,936.00	3.43
103	603609	禾丰牧业	1,166,486.83	3.40
104	601689	拓普集团	1,162,236.00	3.39
105	002158	汉钟精机	1,155,816.00	3.37
106	600123	兰花科创	1,148,005.00	3.35
107	300141	和顺电气	1,141,876.00	3.33
108	002364	中恒电气	1,140,406.00	3.33
109	000526	紫光学大	1,139,083.20	3.32
110	002229	鸿博股份	1,138,712.00	3.32

111	300477	合纵科技	1,134,523.00	3.31
112	603901	永创智能	1,133,254.00	3.31
113	603799	华友钴业	1,130,890.00	3.30
114	600188	兖州煤业	1,129,535.00	3.30
115	600711	盛屯矿业	1,129,036.77	3.30
116	603066	音飞储存	1,128,218.00	3.29
117	002449	国星光电	1,126,365.00	3.29
118	002226	江南化工	1,126,105.00	3.29
119	002635	安洁科技	1,114,476.47	3.25
120	000876	新希望	1,113,330.00	3.25
121	600169	太原重工	1,112,983.00	3.25
122	000826	启迪桑德	1,108,904.00	3.24
123	002273	水晶光电	1,106,997.00	3.23
124	300367	东方网力	1,104,650.46	3.22
125	600900	长江电力	1,104,490.00	3.22
126	300252	金信诺	1,102,287.12	3.22
127	000567	海德股份	1,101,873.00	3.22
128	300224	正海磁材	1,099,217.00	3.21
129	600584	长电科技	1,098,388.00	3.21
130	600674	川投能源	1,097,085.00	3.20
131	300078	思创医惠	1,096,056.60	3.20
132	002501	利源精制	1,094,994.90	3.20
133	002698	博实股份	1,092,160.00	3.19
134	000801	四川九洲	1,091,064.00	3.18
135	000789	万年青	1,090,138.41	3.18
136	601169	北京银行	1,089,476.00	3.18
137	002353	杰瑞股份	1,088,595.00	3.18
138	002142	宁波银行	1,088,357.27	3.18
139	000983	西山煤电	1,086,900.00	3.17
140	600997	开滦股份	1,085,863.00	3.17
141	002636	金安国纪	1,083,934.37	3.16
142	300458	全志科技	1,081,736.58	3.16
143	600502	安徽水利	1,080,200.00	3.15
144	600508	上海能源	1,079,961.17	3.15
145	002190	成飞集成	1,078,766.00	3.15
146	002036	联创电子	1,078,538.00	3.15
147	002385	大北农	1,078,459.24	3.15
148	002518	科士达	1,074,594.00	3.14

149	300056	三维丝	1,074,446.61	3.14
150	002668	奥马电器	1,071,697.00	3.13
151	000601	韶能股份	1,071,458.00	3.13
152	603328	依顿电子	1,069,184.82	3.12
153	600066	宇通客车	1,069,086.33	3.12
154	601002	晋亿实业	1,068,234.72	3.12
155	601799	星宇股份	1,067,658.00	3.12
156	600491	龙元建设	1,067,040.00	3.11
157	002241	歌尔股份	1,064,000.00	3.11
158	300058	蓝色光标	1,063,925.00	3.11
159	300349	金卡股份	1,063,674.00	3.10
160	000700	模塑科技	1,062,946.49	3.10
161	000877	天山股份	1,061,792.00	3.10
162	002121	科陆电子	1,061,610.78	3.10
163	601009	南京银行	1,055,890.00	3.08
164	600236	桂冠电力	1,053,418.10	3.07
165	002413	雷科防务	1,053,413.00	3.07
166	600061	国投安信	1,051,195.00	3.07
167	300011	鼎汉技术	1,047,935.21	3.06
168	002056	横店东磁	1,042,500.00	3.04
169	000967	盈峰环境	1,042,233.84	3.04
170	002480	新筑股份	1,040,567.00	3.04
171	603686	龙马环卫	1,034,842.00	3.02
172	000750	国海证券	1,033,405.00	3.02
173	601939	建设银行	1,031,700.00	3.01
174	600395	盘江股份	1,029,209.00	3.00
175	601788	光大证券	1,028,960.50	3.00
176	600068	葛洲坝	1,026,678.00	3.00
177	601398	工商银行	1,025,800.00	2.99
178	300309	吉艾科技	1,025,183.00	2.99
179	600990	四创电子	1,019,799.30	2.98
180	002709	天赐材料	1,016,579.50	2.97
181	002062	宏润建设	1,015,818.00	2.96
182	002519	银河电子	1,014,732.26	2.96
183	300085	银之杰	1,012,015.00	2.95
184	300236	上海新阳	1,011,221.00	2.95
185	600081	东风科技	1,010,000.00	2.95
186	002612	朗姿股份	1,006,949.48	2.94

187	300470	日机密封	1,006,594.00	2.94
188	300021	大禹节水	1,000,068.60	2.92
189	002125	湘潭电化	996,326.00	2.91
190	300173	智慧松德	988,236.00	2.88
191	002311	海大集团	978,174.91	2.85
192	002643	万润股份	977,104.00	2.85
193	600158	中体产业	968,134.00	2.83
194	600446	金证股份	964,898.00	2.82
195	300461	田中精机	961,615.00	2.81
196	600741	华域汽车	956,400.00	2.79
197	601288	农业银行	948,000.00	2.77
198	000531	穗恒运 A	941,740.92	2.75
199	300230	永利股份	938,858.72	2.74
200	600598	北大荒	935,998.00	2.73
201	600596	新安股份	929,570.00	2.71
202	600104	上汽集团	904,951.00	2.64
203	300545	联得装备	892,303.00	2.60
204	300203	聚光科技	885,033.00	2.58
205	300373	扬杰科技	882,440.00	2.58
206	600478	科力远	837,057.00	2.44
207	600837	海通证券	831,500.00	2.43
208	600820	隧道股份	816,251.00	2.38
209	600048	保利地产	784,300.83	2.29
210	000807	云铝股份	775,000.00	2.26
211	002110	三钢闽光	703,727.00	2.05

### 8.2.3 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	359,311,929.41
卖出股票收入（成交）总额	375,288,930.28

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）填写，不考虑相关交易费用。

### 8.3 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

**8.4 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：本基金本报告期末未持有债券。

**8.5 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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.6 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。

**8.7 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。

**8.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-74,960.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

**8.8.2 本基金投资股指期货的投资政策**

无

**8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.9.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.9.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.10 投资组合报告附注****8.10.1**

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。

### 8.10.2

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。

### 8.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	87,636.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,474.09
5	应收申购款	8,499.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	103,610.10

### 8.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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	600576	万家文化	1,661,000.00	4.85	重大事项停牌
2	300088	长信科技	1,466,000.00	4.28	重大事项停牌

### 8.10.5 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 投资组合报告（转型前）

### 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	34,080,510.00	84.89
	其中：股票	34,080,510.00	84.89
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	5,872,740.22	14.63
7	其他资产	194,706.31	0.48
8	合计	40,147,956.53	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	-	-
B	采矿业	4,089,160.00	10.77
C	制造业	19,141,570.00	50.42
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	3,032,900.00	7.99
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	4,864,360.00	12.81
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,208,020.00	3.18
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	1,744,500.00	4.60
S	综合	-	-
	合计	34,080,510.00	89.77

### 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	300083	劲胜精密	80,000	3,240,800.00	8.54
2	002730	电光科技	70,000	3,112,900.00	8.20
3	600576	万家文化	130,000	3,032,900.00	7.99
4	600475	华光股份	120,000	1,888,800.00	4.98
5	300198	纳川股份	125,000	1,870,000.00	4.93
6	600136	道博股份	30,000	1,744,500.00	4.60
7	300059	东方财富	38,000	1,679,600.00	4.42
8	002612	朗姿股份	20,000	1,270,800.00	3.35
9	002548	金新农	70,000	1,260,000.00	3.32
10	002590	万安科技	50,000	1,223,000.00	3.22
11	000567	海德股份	34,000	1,208,020.00	3.18
12	002121	科陆电子	40,000	1,116,800.00	2.94
13	300458	全志科技	13,000	1,094,730.00	2.88
14	600446	金证股份	28,000	1,091,440.00	2.87
15	300033	同花顺	14,000	1,066,800.00	2.81
16	600489	中金黄金	98,000	1,052,520.00	2.77
17	600547	山东黄金	38,000	1,033,220.00	2.72
18	300236	上海新阳	30,000	1,030,500.00	2.71
19	601689	拓普集团	39,000	1,030,380.00	2.71
20	300085	银之杰	22,000	1,026,520.00	2.70
21	601069	西部黄金	44,000	1,016,840.00	2.68
22	601777	力帆股份	82,000	1,002,860.00	2.64
23	600988	赤峰黄金	58,000	986,580.00	2.60

## 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	300083	劲胜精密	5,218,211.00	11.09
2	002730	电光科技	4,696,997.00	9.98
3	600172	黄河旋风	3,526,695.08	7.49
4	600730	中国高科	3,202,117.00	6.80
5	002284	亚太股份	3,036,739.00	6.45
6	300161	华中数控	2,981,126.56	6.33
7	300033	同花顺	2,856,293.00	6.07
8	600576	万家文化	2,854,006.26	6.06
9	600136	当代明诚	2,795,106.00	5.94
10	300008	天海防务	2,696,882.70	5.73
11	600519	贵州茅台	2,640,844.00	5.61
12	600489	中金黄金	2,365,992.37	5.03
13	601398	工商银行	2,342,600.00	4.98
14	601988	中国银行	2,319,900.00	4.93
15	600547	山东黄金	2,301,433.44	4.89
16	601288	农业银行	2,297,500.00	4.88
17	600395	盘江股份	2,280,056.00	4.84
18	601777	力帆股份	2,223,883.50	4.72
19	603901	永创智能	2,203,467.80	4.68
20	601699	潞安环能	2,195,562.64	4.66
21	002055	得润电子	2,187,016.60	4.65
22	002605	姚记扑克	2,178,767.00	4.63
23	000567	海德股份	2,151,010.94	4.57
24	002235	安妮股份	2,142,736.00	4.55
25	002548	金新农	2,128,011.00	4.52
26	600546	*ST 山煤	2,117,395.00	4.50
27	002488	金固股份	2,011,374.00	4.27
28	600123	兰花科创	1,986,952.78	4.22
29	002335	科华恒盛	1,951,810.00	4.15
30	002329	皇氏集团	1,929,006.00	4.10
31	600475	华光股份	1,888,386.40	4.01

32	002657	中金金财	1,876,767.00	3.99
33	300236	上海新阳	1,855,386.00	3.94
34	300198	纳川股份	1,813,557.89	3.85
35	300356	光一科技	1,800,594.00	3.83
36	002368	太极股份	1,719,153.00	3.65
37	300059	东方财富	1,656,800.00	3.52
38	002407	多氟多	1,615,000.00	3.43
39	002659	中泰桥梁	1,577,081.00	3.35
40	002395	双象股份	1,536,225.00	3.26
41	600478	科力远	1,337,035.00	2.84
42	600195	中牧股份	1,304,406.60	2.77
43	600558	大西洋	1,266,461.00	2.69
44	603318	派思股份	1,264,992.00	2.69
45	601169	北京银行	1,263,750.00	2.68
46	601939	建设银行	1,233,792.00	2.62
47	000983	西山煤电	1,227,831.29	2.61
48	300100	双林股份	1,219,867.00	2.59
49	601998	中信银行	1,209,790.80	2.57
50	600641	万业企业	1,187,039.00	2.52
51	000825	太钢不锈	1,182,960.00	2.51
52	300383	光环新网	1,182,839.00	2.51
53	600016	民生银行	1,181,700.00	2.51
54	600348	阳泉煤业	1,179,767.00	2.51
55	600476	湘邮科技	1,176,766.00	2.50
56	000938	紫光股份	1,169,300.00	2.48
57	600497	驰宏锌锗	1,163,317.00	2.47
58	300458	全志科技	1,153,997.00	2.45
59	000789	万年青	1,151,674.39	2.45
60	002376	新北洋	1,145,597.00	2.43
61	002355	兴民智通	1,144,712.00	2.43
62	300046	台基股份	1,140,421.00	2.42
63	002413	雷科防务	1,132,469.00	2.41
64	600549	厦门钨业	1,128,351.11	2.40
65	002185	华天科技	1,126,640.00	2.39
66	002698	博实股份	1,125,860.16	2.39
67	300309	吉艾科技	1,124,041.00	2.39

68	300467	迅游科技	1,120,962.00	2.38
69	000700	模塑科技	1,120,081.14	2.38
70	002279	久其软件	1,117,758.00	2.37
71	002188	巴士在线	1,115,649.00	2.37
72	000997	新大陆	1,111,742.18	2.36
73	000877	天山股份	1,109,003.95	2.36
74	000959	首钢股份	1,108,194.00	2.35
75	300097	智云股份	1,104,933.00	2.35
76	300202	聚龙股份	1,104,757.00	2.35
77	600850	华东电脑	1,095,085.00	2.33
78	002367	康力电梯	1,092,728.02	2.32
79	002527	新时达	1,091,492.00	2.32
80	601799	星宇股份	1,084,750.42	2.30
81	000750	国海证券	1,082,700.00	2.30
82	600303	曙光股份	1,078,795.00	2.29
83	002097	山河智能	1,077,957.08	2.29
84	601069	西部黄金	1,077,533.00	2.29
85	600988	赤峰黄金	1,076,472.00	2.29
86	600081	东风科技	1,075,330.78	2.28
87	000060	中金岭南	1,074,700.00	2.28
88	002304	洋河股份	1,071,748.77	2.28
89	300228	富瑞特装	1,071,316.00	2.28
90	002668	奥马电器	1,070,097.57	2.27
91	601001	大同煤业	1,068,658.00	2.27
92	002590	万安科技	1,064,339.00	2.26
93	600855	航天长峰	1,058,142.00	2.25
94	000779	三毛派神	1,057,892.20	2.25
95	600403	大有能源	1,056,622.00	2.24
96	002554	惠博普	1,055,982.00	2.24
97	601689	拓普集团	1,047,246.00	2.22
98	000687	华讯方舟	1,045,842.00	2.22
99	601788	光大证券	1,041,124.18	2.21
100	300148	天舟文化	1,039,904.00	2.21
101	002655	共达电声	1,039,550.00	2.21
102	600446	金证股份	1,038,452.00	2.21
103	300310	宜通世纪	1,034,558.00	2.20

104	600501	航天晨光	1,029,444.00	2.19
105	601198	东兴证券	1,028,000.00	2.18
106	000932	华菱钢铁	1,027,614.49	2.18
107	300164	通源石油	1,020,925.00	2.17
108	300054	鼎龙股份	1,020,401.01	2.17
109	002121	科陆电子	1,018,282.28	2.16
110	600782	新钢股份	1,018,226.00	2.16
111	000793	华闻传媒	1,017,000.00	2.16
112	002197	证通电子	1,014,988.00	2.16
113	300085	银之杰	1,012,311.00	2.15
114	300442	普丽盛	1,007,069.00	2.14
115	000937	冀中能源	1,001,043.12	2.13
116	300339	润和软件	975,448.00	2.07
117	600593	大连圣亚	954,742.00	2.03
118	300352	北信源	950,923.00	2.02
119	000697	炼石有色	944,500.00	2.01
120	002253	川大智胜	941,415.22	2.00

#### 8.4.2 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	002605	姚记扑克	3,251,456.90	6.91
2	600730	中国高科	3,170,242.00	6.74
3	300113	顺网科技	3,124,031.40	6.64
4	300008	天海防务	2,785,028.66	5.92
5	600519	贵州茅台	2,719,097.00	5.78
6	601398	工商银行	2,306,900.00	4.90
7	601288	农业银行	2,288,000.00	4.86
8	601988	中国银行	2,257,200.00	4.80
9	000558	莱茵体育	2,216,565.00	4.71
10	600395	盘江股份	2,209,875.00	4.69
11	002611	东方精工	2,062,611.40	4.38
12	601699	潞安环能	2,047,005.00	4.35
13	002235	安妮股份	2,039,225.00	4.33
14	000938	紫光股份	2,023,711.00	4.30

15	600546	*ST 山煤	2,011,570.00	4.27
16	600593	大连圣亚	2,010,731.00	4.27
17	000793	华闻传媒	1,992,283.00	4.23
18	300467	迅游科技	1,964,955.00	4.17
19	603611	诺力股份	1,863,332.00	3.96
20	300356	光一科技	1,827,500.88	3.88
21	002329	皇氏集团	1,824,581.29	3.88
22	600172	黄河旋风	1,811,820.00	3.85
23	002395	双象股份	1,801,393.23	3.83
24	002407	多氟多	1,794,281.00	3.81
25	002280	联络互动	1,787,963.00	3.80
26	600123	兰花科创	1,766,346.50	3.75
27	002657	中科金财	1,766,045.00	3.75
28	300161	华中数控	1,717,535.75	3.65
29	002368	太极股份	1,611,718.00	3.42
30	002335	科华恒盛	1,588,217.76	3.37
31	300083	劲胜精密	1,458,701.00	3.10
32	002253	川大智胜	1,457,496.00	3.10
33	600489	中金黄金	1,306,000.00	2.77
34	603901	永创智能	1,290,170.34	2.74
35	601169	北京银行	1,252,500.00	2.66
36	600547	山东黄金	1,231,800.00	2.62
37	600476	湘邮科技	1,223,387.00	2.60
38	600641	万业企业	1,214,539.00	2.58
39	002517	恺英网络	1,213,091.00	2.58
40	300202	聚龙股份	1,203,582.06	2.56
41	000983	西山煤电	1,201,792.75	2.55
42	002036	联创电子	1,193,975.00	2.54
43	002279	久其软件	1,183,382.90	2.51
44	002362	汉王科技	1,177,221.00	2.50
45	600158	中体产业	1,171,367.00	2.49
46	000567	海德股份	1,167,184.78	2.48
47	603318	派思股份	1,159,725.00	2.46
48	601939	建设银行	1,153,800.00	2.45
49	300307	慈星股份	1,147,672.00	2.44
50	000997	新大陆	1,147,430.00	2.44
51	300148	天舟文化	1,136,137.66	2.41
52	002444	巨星科技	1,135,050.00	2.41

53	002097	山河智能	1,123,378.19	2.39
54	600303	曙光股份	1,121,978.00	2.38
55	002222	福晶科技	1,115,292.00	2.37
56	300046	台基股份	1,115,014.00	2.37
57	601777	力帆股份	1,113,075.00	2.36
58	002367	康力电梯	1,107,683.79	2.35
59	000959	首钢股份	1,098,102.00	2.33
60	600016	民生银行	1,094,848.94	2.33
61	002634	棒杰股份	1,093,509.50	2.32
62	600549	厦门钨业	1,088,003.40	2.31
63	002304	洋河股份	1,084,170.00	2.30
64	002185	华天科技	1,080,694.00	2.30
65	600497	驰宏锌锗	1,078,800.00	2.29
66	002776	柏堡龙	1,078,359.20	2.29
67	600348	阳泉煤业	1,077,800.00	2.29
68	300219	鸿利智汇	1,075,520.00	2.28
69	002527	新时达	1,070,782.15	2.27
70	300164	通源石油	1,063,700.00	2.26
71	000932	华菱钢铁	1,041,487.00	2.21
72	600850	华东电脑	1,040,651.00	2.21
73	002554	惠博普	1,037,784.00	2.20
74	300054	鼎龙股份	1,023,859.56	2.18
75	300339	润和软件	1,016,385.00	2.16
76	000697	炼石有色	1,016,076.82	2.16
77	600260	凯乐科技	1,012,912.00	2.15
78	002284	亚太股份	1,012,663.00	2.15
79	002396	星网锐捷	1,005,362.00	2.14
80	002413	雷科防务	1,002,738.00	2.13
81	601998	中信银行	999,000.00	2.12
82	002376	新北洋	994,762.00	2.11
83	300309	吉艾科技	992,786.15	2.11
84	002052	同洲电子	991,853.87	2.11
85	600501	航天晨光	990,689.00	2.10
86	002587	奥拓电子	985,223.00	2.09
87	000060	中金岭南	970,091.15	2.06
88	600195	中牧股份	965,807.40	2.05
89	300383	光环新网	953,167.00	2.02
90	600403	大有能源	953,115.00	2.02

91	000825	太钢不锈	951,000.00	2.02
92	600855	航天长峰	949,902.00	2.02
93	002055	得润电子	943,549.00	2.00
94	002371	七星电子	943,079.00	2.00

### 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	160,707,576.56
卖出股票收入（成交）总额	156,925,042.19

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 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：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

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

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

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

浙江核新同花顺网络信息股份有限公司开发具有开立证券交易子账户、接受证券交易委托、查询证券交易信息、进行证券和资金的交易结算清算等多种证券业务属性功能的系统。通过该系统，投资者不履行实名开户程序即可进行证券交易。公司在明知客户的经营方式的情况下，仍向不具有经营证券业务资质的客户销售系统、提供相关服务。公司的上述行为违反了《证券法》第一百二十二条的规定，构成《证券法》第一百九十七条所述非法经营证券业务的行为。对于以上行为，该公司于2015年9月7日收到中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚事先告知书》（编号：处罚字[2015]70号）。如公司受到中国证监会行政处罚，并且被认定构成重大违法行为，同花顺（300033）可能被深圳证券交易所实施暂停上市，请广大投资者注意投资风险。

### 8.12.2

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。

### 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	144,236.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,501.83
5	应收申购款	43,968.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	194,706.31

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**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	002730	电光科技	3,112,900.00	8.20	重大事项停牌
2	002612	朗姿股份	1,270,800.00	3.35	重大事项停牌

**8.12.5 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（转型后）****9.3 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
2,544	9,025.40	2,668,456.92	11.62%	20,292,160.78	88.38%

**9.4 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	68,760.40	0.30%

**9.5 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

**§ 9 基金份额持有人信息（转型前）****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
2,501	9,637.34	2,668,456.92	11.07%	21,434,534.39	88.93%

**9.2 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	13,807.60	0.06%

**9.3 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(转型后)**

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	24,102,991.31
本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	6,466,311.30

减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	7,608,684.91
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)	-
本报告期期末基金份额总额	22,960,617.70

## § 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	248,496,003.92
本报告期期初基金份额总额	23,584,005.53
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	26,754,201.98
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	26,235,216.20
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)	-
本报告期期末基金份额总额	24,102,991.31

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2016 年 3 月 17 日至 2016 年 4 月 6 日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议了《关于天治创新先锋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 7 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 8 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创新先锋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 7 日表决通过了《关于天治创新先锋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。

### 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》。

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。

### 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

转型后，本基金的投资策略为以股票投资为主，一般情况下本基金将保持配置的基本稳定，最高可达 95%。当股票市场的整体估值水平严重偏离企业实际的盈利状况和预期成长率，出现明显的价值高估，如果不及时调整将可能给基金持有人带来潜在的资本损失时，本基金将进行大类资产配置调整，降低股票资产的比例（最低为 0%），同时利用提高债券配置比例及利用股指期货进行套期保值等方法规避市场系统性风险。

转型前，本基金的投资策略为以股票品种为主要投资标的，优选通过差异化和低成本不断创新价值、追求持续领先优势的创新先锋型公司，分享其价值创新带来的高成长收益。

### 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 2008 年 5 月 8 日（原基金合同生效日）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（转型后）

#### 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	
国信证券	1	397,097,643.68	54.06%	361,874.51	53.66%	-
华创证券	1	195,666,923.92	26.64%	182,224.46	27.02%	-
国泰君安	1	48,915,026.76	6.66%	44,576.41	6.61%	-

广发证券	1	41,742,666.66	5.68%	38,040.06	5.64%	-
申银万国	1	30,417,545.89	4.14%	28,327.57	4.20%	-
国金证券	1	20,761,052.78	2.83%	19,334.46	2.87%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
长江证券(退)	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券(退)	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、报告期内本基金退租长江证券、齐鲁证券各 1 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
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	7,000,000.00	100.00%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券(退)	-	-	-	-	-	-

华西证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券（退）	-	-	-	-	-	-

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 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	
国信证券	1	125,900,177.35	39.64%	114,733.04	39.30%	-
国泰君安	1	67,867,995.30	21.37%	61,848.36	21.19%	-
申银万国	1	67,267,423.18	21.18%	62,646.03	21.46%	-
华创证券	1	56,597,022.92	17.82%	52,709.14	18.05%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券（退）	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
长江证券（退）	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、报告期内本基金退租长江证券、齐鲁证券各 1 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
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	10,000,000.00	100.00%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券(退)	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券(退)	-	-	-	-	-	-

### 11.9 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	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持广生堂股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年4月8日
2	天治公司关于天治创新先锋混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效和基金名称变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年4月8日
3	天治基金管理有限公司关于天治创新先锋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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年4月8日
4	天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年4月8日

5	天治中国制造 2025 灵活配置 混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、证券时 报、上海证券报及公 司官网	2016 年 4 月 8 日
6	天治中国制造 2025 灵活配置 混合型证券投资基金招募说明 书	中国证券报、证券时 报、上海证券报及公 司官网	2016 年 4 月 8 日
7	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	中国证券报、证券时 报、上海证券报及公 司官网	2016 年 4 月 16 日
8	天治创新先锋混合型证券投资 基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时 报、上海证券报及公 司官网	2016 年 4 月 21 日
9	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	中国证券报、证券时 报、上海证券报及公 司官网	2016 年 4 月 22 日
10	关于天治基金公司淘宝店关闭 申购服务的公告	中国证券报、证券时 报、上海证券报及公 司官网	2016 年 5 月 5 日
11	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	中国证券报、证券时 报、上海证券报及公 司官网	2016 年 5 月 5 日
12	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	中国证券报、证券时 报、上海证券报及公 司官网	2016 年 5 月 6 日
13	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	中国证券报、证券时 报、上海证券报及公 司官网	2016 年 5 月 12 日
14	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	中国证券报、证券时 报、上海证券报及公	2016 年 6 月 3 日

	估值方法的公告	司官网	
15	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年6月4日
16	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年6月8日
17	天治基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年6月21日
18	天治基金管理有限公司旗下部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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年6月24日
19	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年6月29日
20	天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金第 2 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年7月19日
21	天治基金管理有限公司更正公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年8月6日
22	天治基金管理有限公司关于旗下基金增加大泰金石为代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年8月17日
23	天治基金管理有限公司关于旗下基金增加金观诚为代销机构、开通定期定额投资业务和	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年8月24日

	基金转换业务并参加费率优惠活动的公告		
24	天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016 年 8 月 29 日
25	天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016 年 9 月 20 日
26	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加钱景财富为代销机构、开通定期定额投资业务和基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016 年 9 月 28 日
27	天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第三季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016 年 10 月 26 日
28	天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要(2016 年第 1 次)	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016 年 11 月 18 日
29	天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016 年 11 月 29 日
30	天治基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016 年 12 月 8 日
31	天治基金管理有限公司关于调	中国证券报、证券时	2016 年 12 月 14 日

	整旗下基金所持长信科技、万家文化股票估值方法的公告	报、上海证券报及公司官网	
32	天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年12月22日
33	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2017倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年12月29日
34	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年12月29日
35	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年12月30日

### 11.9 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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年1月6日
3	天治基金关于指数熔断期间暂	中国证券报、证券时	2016年1月6日

	停申购赎回业务的公告	报、上海证券报及公司官网	
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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年1月12日
9	天治创新先锋混合型证券投资基金2015年第4季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年1月22日
10	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年1月30日
11	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年2月3日
12	天治基金管理有限公司关于调	中国证券报、证券时	2016年2月6日

	整旗下基金所持金叶珠宝股票估值方法的公告	报、上海证券报及公司官网	
13	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年2月24日
14	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年2月25日
15	天治基金管理有限公司关于以通讯方式召开天治创新先锋混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年2月26日
16	天治基金管理有限公司关于以通讯方式召开天治创新先锋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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年2月26日
17	天治基金管理有限公司关于以通讯方式召开天治创新先锋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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年2月26日
18	天治基金管理有限公司更正公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年2月27日
19	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年3月2日
20	天治基金管理有限公司关于天治创新先锋混合型证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年3月3日

	告		
21	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年3月25日
22	天治创新先锋混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年3月30日
23	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网	2016年4月1日

## § 12 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金及天治创新先锋混合型证券投资基金募集的文件
2. 《天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《天治创新先锋混合型证券投资基金基金合同》
3. 《天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》、《天治创新先锋混合型证券投资基金招募说明书》
4. 《天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《天治创新先锋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. 报告期内天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、天治创新先锋混合型证券投资基金公告的各项原稿

### 13.2 存放地点

上海市复兴西路 159 号

### 13.3 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](http://www.chinanature.com.cn)

天治基金管理有限公司  
2017年3月30日