

天治核心成长混合型证券投资基金（LOF） 2017 年年度报告

2017 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：2018 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2018 年 3 月 27 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 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	64

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	64
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	64
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	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末上市基金前十名持有人	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	67
§10 开放式基金份额变动	68
§11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
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	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8 其他重大事件	73
§12 影响投资者决策的其他重要信息	78
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	天治核心成长混合（LOF）
场内简称	天治核心
基金主代码	163503
交易代码	163503
基金运作方式	契约型上市开放式（LOF）
基金合同生效日	2006 年 1 月 20 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	1,187,764,950.39 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007 年 7 月 30 日

2.2 基金产品说明

投资目标	通过将部分资产投资于品质优良、成长潜力高于平均水平的中小型上市公司股票，并将部分资产用于复制大型上市公司股票指数（富时中国 A200 指数）的业绩表现，在控制相对市场风险的前提下，追求中长期的资本增值。
投资策略	本基金以股票品种为主要投资标的，以“核心—卫星”策略作为股票投资的总体策略。“核心—卫星”策略是指将股票资产分为核心组合和卫星组合，核心组合通过跟踪指数进行被动投资，控制投资组合相对于市场的风险；卫星组合通过优选股票进行主动投资，追求超越市场平均水平的收益。本基金的核心组合用于跟踪大型公司股票指数（富时中国 A200 指数），卫星组合用于优选中小型成长公司股票。
业绩比较基准	富时中国 A 全指×75%+富时中国国债指数×25%。
风险收益特征	本基金为具有中等风险、中高收益的混合型基金，风险收益特征介于大盘平衡型基金和小盘成长型基金之间。

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	陆志俊
	联系电话	021-60371155	95559
	电子邮箱	zhaozz@chinanature.com.cn	luzj@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		吕文龙	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》、《证券日报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	25,912,587.16	-283,767,376.86	1,245,937,532.44
本期利润	46,223,882.00	-294,217,970.27	843,818,567.04
加权平均基金份额本期利润	0.0368	-0.2206	0.4606
本期加权平均净值利润率	7.72%	-40.18%	53.51%
本期基金份额净值增长率	7.68%	-40.55%	32.79%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-14,494,687.33	-66,104,335.95	453,975,863.77
期末可供分配基金份额利润	-0.0122	-0.0479	0.3982
期末基金资产净值	594,212,639.86	640,855,123.48	1,038,251,710.34
期末基金份额净值	0.5003	0.4646	0.9107
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	152.44%	134.42%	294.30%

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

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

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

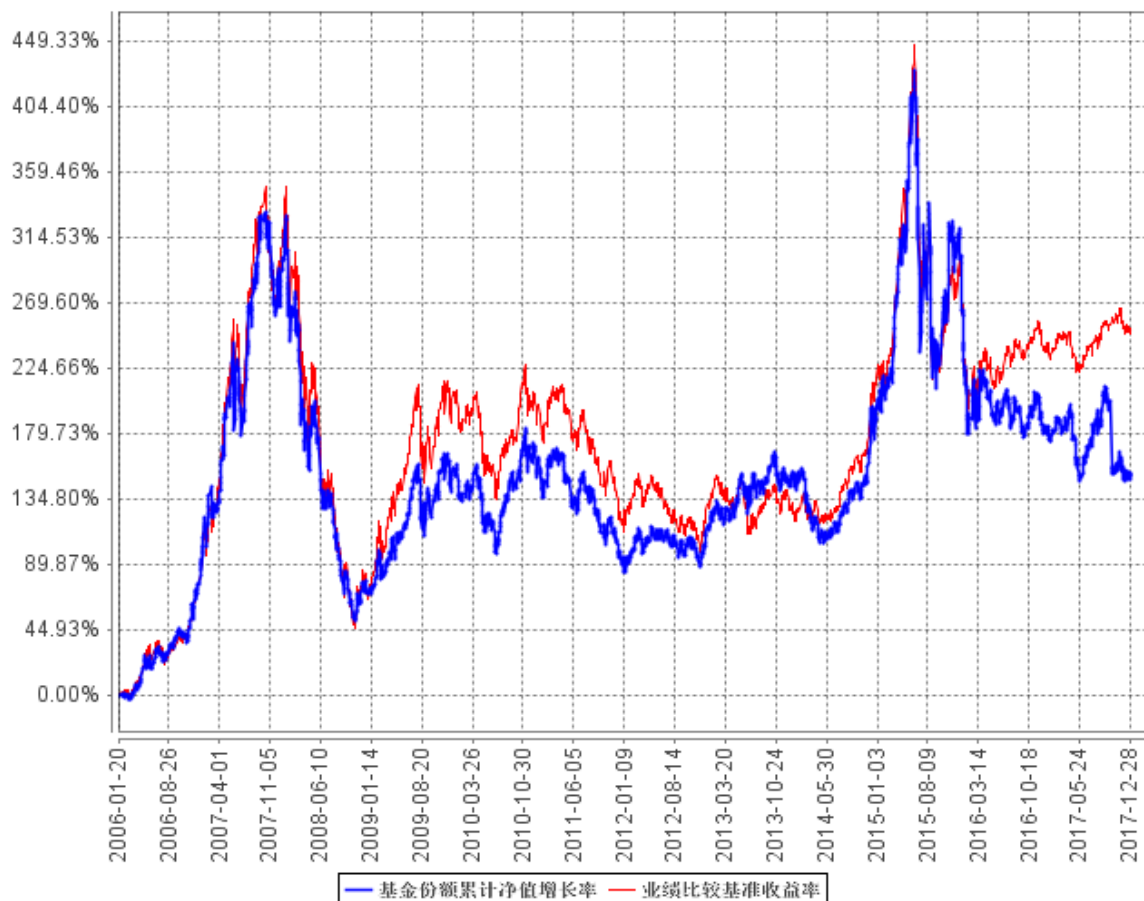
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.30%	1.10%	-0.58%	0.55%	0.28%	0.55%
过去六个月	11.35%	1.19%	3.35%	0.52%	8.00%	0.67%
过去一年	7.68%	1.09%	4.03%	0.51%	3.65%	0.58%
过去三年	-14.99%	2.02%	10.83%	1.33%	-25.82%	0.69%
过去五年	16.57%	1.77%	48.05%	1.19%	-31.48%	0.58%
自基金合同生效起至今	152.44%	1.68%	252.04%	1.37%	-99.60%	0.31%

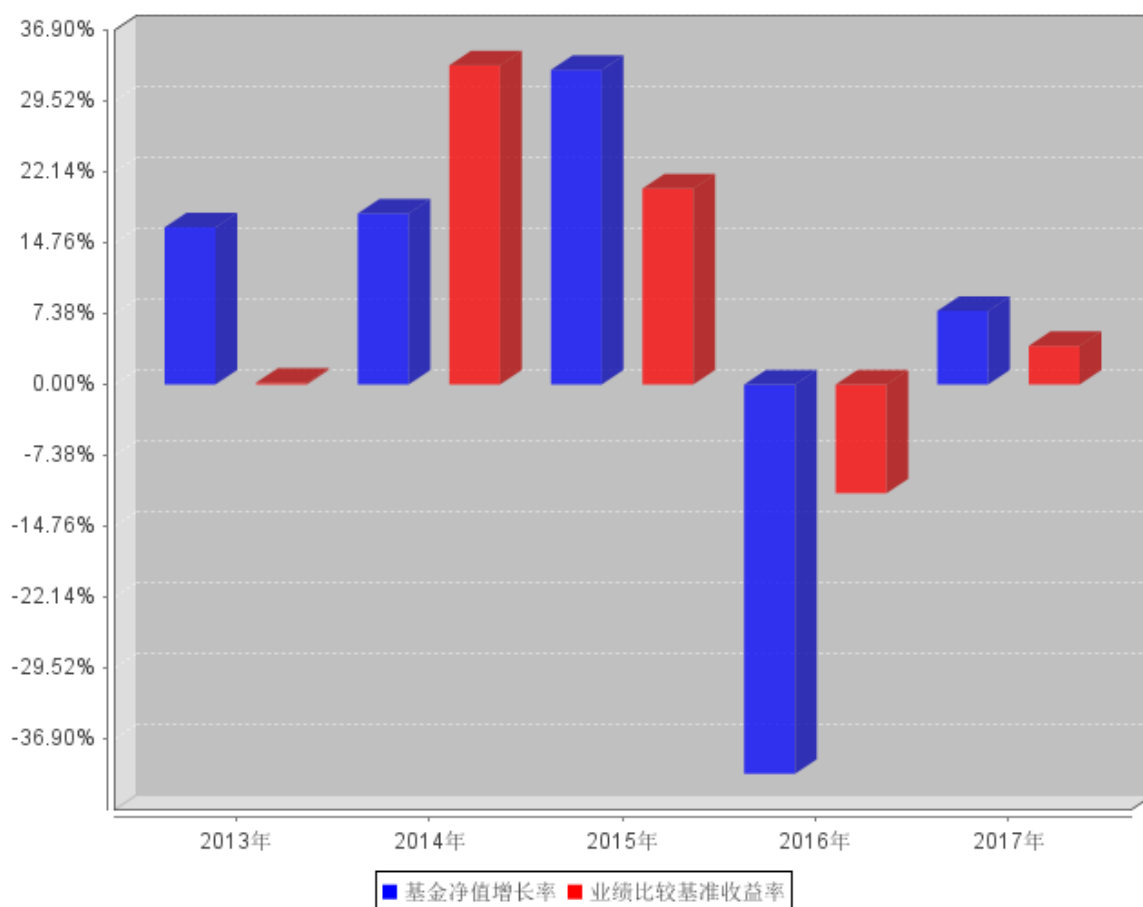
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每 10 份 基金 份 额 分 红 数	现 金 形 式 发 放 总 额	再 投 资 形 式 发 放 总 额	年 度 利 润 分 配 合 计	备 注
2017	-	-	-	-	
2016	2.0000	369,017,783.77	80,960,456.20	449,978,239.97	
2015	0.0800	16,872,805.11	7,761,285.59	24,634,090.70	
合计	2.0800	385,890,588.88	88,721,741.79	474,612,330.67	

§ 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 2017 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）、天治财富增长证券投资基金、天治天得利货币市场基金、天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金（转型自 2008 年 5 月 8 日生效的天治创新先锋混合型证券投资基金）、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、天治新消费灵活配置混合型证券投资基金（转型自 2011 年 8 月 4 日生效的天治成长精选混合型证券投资基金）、天治可转债增强债券型证券投资基金、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金（转型自 2011 年 12 月 28 日生效的天治稳定收益债券型证券投资基金）、天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的基金合同分别于 2008 年 11 月 5 日、2016 年 4 月 18 日、2004 年 6 月 29 日、2006 年 7 月 5 日、2016 年 4 月 7 日、2009 年 7 月 15 日、2016 年 7 月 6 日、2013 年 6 月 4 日、2015 年 6 月 9 日、2016 年 12 月 7 日生效。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许家涵	权益投资部总监、公司投资副总监、本基金基金经理	2015年6月2日	-	12年	经济学学士，具有基金从业资格。2005年7月至2007年9月就职于吉林省信托有限责任公司任自营资金部职员，2007年9月至今就职于天治基金管理有限公司，历任交易员、交易部总监助理、交易部副总监、交易部总监，现任权益投资部总监、公司投资副总监。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定制定了公司《公平交易制度》。公司公平交易体系涵盖研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节, 各环节公平措施简要如下:

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

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

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

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

公司对银行间市场交易价格异常的控制采用事前审查的方法。回购利率异常指回购利率偏离同期公允回购利率 30bp 以上; 现券交易价格异常指根据交易价格推算出的收益率偏离同期公允收

益率 30bp 以上（一年期以上债券为 50bp），其中，货币基金的现券交易价格异常指根据交易价格推算出的收益率偏离同期公允收益率 30bp 以上。

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

具体方法如下：

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

报告期内，本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年以来，A 股市场投资风格分化十分明显，以贵州茅台、恒瑞医药等为代表的优质蓝筹股年内股价一路高歌猛进，上证 50 指数屡创新高，全年收涨 25.08%；上证综指、深证成指也分别取得 6.56%、8.48% 的涨幅，中小板指在年中突飞猛进后年末开始持续调整，创业板全年震荡下

跌 10.67%。从行业上看，28 个申万一级行业中，刚好一半行业年内上涨，食品饮料、家用电器排名第一、二位，涨幅分别为 55.57%、39.76%。从跌幅排行来看，纺织服装、传媒行业、综合类表现最差，年内跌幅均超过 20%。

全年来看，2017 年是价值投资理念逐步回归的一年，蓝筹股、白马股、周期股表现不俗；价值与成长并重的科技股也不甘落后，在四季度大放异彩。而业绩不理想的小盘题材股则被资金抛弃，股价重心不断下移。

从驱动股价上涨的两个核心因素来看，盈利明显向上，因为 2017 年国内经济 L 型筑底并有温和复苏的势头，多个经济景气指数也有所好转，供给侧改革已经初见成效，企业效益边际改善，因此从前三季度的数据推测全年整体利润增速约在 20%左右，较 2016 年有明显的回升。但从主要指数的 PE 变化可以发现，估值的波动成为了影响股价走势最重要的因素，如上证 50 和沪深 300，在 2017 年的大涨中 PE 上升也很明显，而中小市值个股为主的中证 1000 指数的估值水平下降非常快，PE 从年初的 65 倍以上已经下降到年末的只有 35 倍左右。

回顾本基金 2017 年的表现，一季度均衡配置，净值稳步提升。二季度重配受益“一带一路”及“雄安”的建筑板块，导致阶段回撤较大。三季度重配钢铁、有色、煤炭等周期板块，净值大幅上涨。四季度，分散配置各行业龙头，表现的相对稳健。2018 年，本基金将坚持价值投资，更加注重控制投资组合的回撤，努力为投资者取得更好的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末，本基金份额净值为 0.5003 元，报告期内本基金份额净值增长率为 7.68%，业绩比较基准收益率为 4.03%，高于同期业绩比较基准收益率 3.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，我们认为，通胀压力有限，宏观经济将延续复苏态势。投资方面，政策思路继续转变，继续贯彻重“质”轻“量”的思路，强调转变发展方式、优化经济结构、转换增长动力；消费方面，2017 年人均收入水平的提高、三四线城市及乡村消费增速的提高为 2018 年的消费增长提供了强有力的保证；进出口方面，全球经济复苏势头确立，给我国进出口贸易带来正向溢出效应。财政及货币政策方面，财政偏积极，财政投入更加强调有的放矢，优化结构摆在更重要的位置；货币政策偏稳健，去杠杆背景下，流动性收紧，利率中枢抬升。

总体来看，预计指数波动将加大，但中枢将呈上移趋势，低估值价值蓝筹仍然是主线，继续看好股市的结构性分化行情。大风格不变，小风格轮动，上半年上证综指有望在蓝筹板块的引领下继续走出慢牛走势，下半年成长股投资机会或将显现。在“类滞胀”组合下，基本面与流动性

的组合对于整体股市的运行难言利好，权益资产存在相对价值，风格轮动向“周期、消费、金融、成长”多风格进行切换。

我们主要看好方向可以概括为：金融地产+消费+中游制造+成长。因此，立足于行业、公司基本面，本基金将继续选择低估值蓝筹股为底仓配置，并围绕供给侧改革、大宗商品涨价、5G 等主题进行投资。另外，时刻注意防范系统性风险，努力控制回撤，争取为投资者带来持续稳定的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017 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《天治基金关联交易管理办法》、《天治基金反洗钱内部控制制度》、《天治基金投资者适当性管理制度》、《天治基金专户业务第三方投资顾问机构管理制度》、《天治基金特定客户资产管理业务利益冲突防范制度》、《天治基金合规管理制度》、《天治基金内部控制大纲》、《天治基金风险控制制度》、《风险处置预案》（含《天治基金流动性管理规定》）、《天治基金逆回购质押品管理制度》、《天治基金子公司管理制度》、《天治基金内部审计制度》、《天治基金通信管理制度》、《天治基金保密制度》、《天治基金与子公司之间的风险隔离制度》、《天治基金例行检查办法》、《天治基金员工本人、配偶、利害关系人证券投资管理办法》、《天治基金员工投资证券投资基金管理办法》、《天治基金会会计核算制度》、《天治基金基金会计制度》、《天治基金公募基金压力测试制度》、《研究发展部管理制度》、《研究发展部工作手册》、《基金结算部管理制度》、《投资管理制度》、《股指期货投资管理制度》、《信息披露制度》、《监察稽核制度》、《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记录及档案管理制度》、《特定客户资产管理业务监察稽核制度》、《特定客户资产管理业务危机处理制度》、《特定客户资产投资管理制度》、《国债期货风险管理制度》、《旗下基金投资流通受限证券流动性风险处置预案》、《公平交易制度》、《计算机病毒防范管理办法》、《计算机软件管理办法》等管理制度。同时，监察稽核部继续严格依据法律法规和公司规章制度独立行使职责，通过定期或不定期检查、专项检查等方式，监督公司各项制度执行情况（监督监察内容包括但不限于投资组合的投资研究、投资决策、交易执行和投资风险、绩效评估等情况、产品研发流程、基金销售、宣传推介、客户服务、信息技术日常处理及

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

二、继续加强投资监控，防范投资运作风险。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人的基金估值和会计核算由基金结算部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制。基金结算部人员均具备基金从业资格和会计专业工作经历。为确保基金资产估值的公平、合理、合规，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了天治基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了有关议事规则。估值委员会成员包括公司投资决策委员会成员、负责基金结算的管理层、监察稽核部总监、产品创新及量化投资部总监等，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对于权益投资部、固定收益部以及产品创新及量化投资部提交的估值模型和估值结果进行论证审核，并签署最终意见。基金经理会参与估值，与产品创新及量化投资部一同根据估值模型、估值程序计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，将估值结果提交公司估值委员会。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，根据相关法律法规和基金合同的规定，不进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现持有人数少于 200 人或基金资产净值低于 5000 万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，基金托管人在天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，天治基金管理有限公司在天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的规定。

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

报告期内，由天治基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2018)审字第 60467615_B03 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	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于天治核心成长混合型证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。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>
其他信息	<p>天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估天治核心成长混合型证券投资</p>

	<p>基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可</p>

	<p>能导致天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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）
注册会计师的姓名	蒋燕华 石静筠
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	2018 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	46,769,754.50	1,276,469.47
结算备付金		6,930,977.61	65,606,395.76
存出保证金		671,261.59	936,049.69
交易性金融资产	7.4.7.2	560,372,548.48	489,534,026.65
其中：股票投资		558,539,172.38	489,534,026.65
基金投资		-	-
债券投资		1,833,376.10	-
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	-	30,000,165.00
应收证券清算款		-	65,039,333.24
应收利息	7.4.7.5	13,896.12	24,113.99
应收股利		-	-
应收申购款		8,543.50	25,498.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		614,766,981.80	652,442,052.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
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		10,213,708.39	-
应付赎回款		416,036.02	147,672.20
应付管理人报酬		605,679.68	669,377.16
应付托管费		126,183.25	139,453.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	8,754,947.09	10,082,848.48
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	437,787.51	547,577.44
负债合计		20,554,341.94	11,586,928.84
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	608,707,327.19	706,959,459.43
未分配利润	7.4.7.10	-14,494,687.33	-66,104,335.95
所有者权益合计		594,212,639.86	640,855,123.48
负债和所有者权益总计		614,766,981.80	652,442,052.32

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.5003 元，基金份额总额 1,187,764,950.39 份。

7.2 利润表

会计主体：天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		75,175,522.22	-253,859,236.26
1. 利息收入		890,906.31	2,171,063.40
其中：存款利息收入	7.4.7.11	868,156.35	2,051,003.05
债券利息收入		3,489.92	44.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		19,260.04	120,015.60
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		53,887,749.94	-246,282,434.42
其中：股票投资收益	7.4.7.12	48,015,396.40	-252,057,353.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	441,692.42	40,400.05
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	5,430,661.12	5,734,519.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	20,311,294.84	-10,450,593.41
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	85,571.13	702,728.17
减：二、费用		28,951,640.22	40,358,734.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,180,009.07	8,789,261.03

2. 托管费	7.4.10.2.2	1,495,835.23	1,831,096.08
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	19,769,221.49	29,117,721.46
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	506,574.43	620,655.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,223,882.00	-294,217,970.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,223,882.00	-294,217,970.27

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	706,959,459.43	-66,104,335.95	640,855,123.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	46,223,882.00	46,223,882.00
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）	-98,252,132.24	5,385,766.62	-92,866,365.62
其中：1. 基金申购款	19,975,537.73	-1,820,141.99	18,155,395.74
2. 基金赎回款	-118,227,669.97	7,205,908.61	-111,021,761.36
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）	608,707,327.19	-14,494,687.33	594,212,639.86
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	584,275,846.57	453,975,863.77	1,038,251,710.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-294,217,970.27	-294,217,970.27
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）	122,683,612.86	224,116,010.52	346,799,623.38
其中：1. 基金申购款	694,844,601.40	237,323,481.77	932,168,083.17
2. 基金赎回款	-572,160,988.54	-13,207,471.25	-585,368,459.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-449,978,239.97	-449,978,239.97
五、期末所有者权益（基金净值）	706,959,459.43	-66,104,335.95	640,855,123.48

注：报告附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）（原名天治核心成长股票型证券投资基金（LOF））（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2005]134 号文《关于同意天治核心成长股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人天治基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2006 年 1 月 20 日正式生效，首次设立募集规模为 313,493,538.86 份基金份额。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天治基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

鉴于《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》的相关要求，经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，自 2015

年 8 月 4 日起本基金更名为天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市各类股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金以股票品种为主要投资标的，以“核心—卫星”策略作为股票投资的总体策略。在一般情况下，本基金的资产类别配置的范围为：股票投资比例为基金净资产的 60%–95%，其中，核心组合的投资比例为股票资产净值的 55%–65%，卫星组合的投资比例为股票资产净值的 35%–45%；债券投资比例为基金净资产的 0%–40%，现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具不低于基金净资产的 5%。

本基金的业绩比较基准为：富时中国 A 全指×75%+富时中国国债指数×25%。

2007 年 10 月 15 日（拆分日），本基金管理人天治基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分后基金份额面值为人民币 0.5125 元。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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（以下统称“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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 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。

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，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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；

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；

(4) 股指期货投资

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

本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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应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确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

(2) 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；

(3) 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；

(4) 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；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（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；

(6) 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；

(7) 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；

(8) 资产支持证券投资收益/（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；

(9) 权证收益/（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；

(10) 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；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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；

(12) 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

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益分配比例按有关规定制定，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的50%；

(3) 基金投资当期亏损，则不进行收益分配；

(4) 基金当年收益应先弥补以前年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(5) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(6) 基金份额登记在注册登记系统的投资者可以选择现金分红或红利再投资；基金份额登记在证券登记结算系统的投资者只能选择现金分红；本基金分红的默认方式为现金分红；投资人选择

红利再投资时，分配的基金收益以权益登记日的基金份额净值为基准自动转换为基金份额进行再投资；

(7) 基金收益每年最多分配 6 次，但若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(8) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（以下简称“估值业务指引”），自 2017 年 12 月 15 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。该会计估计变更对本基金本期末的基金资产净值及本期损益均无影响。

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. 增值税

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	46,769,754.50	1,276,469.47
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	46,769,754.50	1,276,469.47

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		543,421,019.52	558,539,172.38	15,118,152.86
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,921,000.00	1,833,376.10	-87,623.90
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,921,000.00	1,833,376.10	-87,623.90
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		545,342,019.52	560,372,548.48	15,030,528.96
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		494,814,792.53	489,534,026.65	-5,280,765.88
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		494,814,792.53	489,534,026.65	-5,280,765.88

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-

合计	-	-
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	30,000,165.00	-
合计	30,000,165.00	-

注：本基金本报告期末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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	7,949.81	6,796.38
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	3,118.90	13,115.76
应收债券利息	2,525.31	-
应收买入返售证券利息	-	3,780.52
应收申购款利息	-	0.13
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	302.10	421.20
合计	13,896.12	24,113.99

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	8,754,947.09	10,082,022.48
银行间市场应付交易费用	-	826.00
合计	8,754,947.09	10,082,848.48

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	399.57	189.50
其他	67,387.94	67,387.94
预提信息披露费	300,000.00	400,000.00
预提审计费	70,000.00	80,000.00
合计	437,787.51	547,577.44

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,379,484,993.00	706,959,459.43
本期申购	38,977,965.09	19,975,537.73
本期赎回（以“-”号填列）	-230,698,007.70	-118,227,669.97
- 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	1,187,764,950.39	608,707,327.19

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	282,126,222.58	-348,230,558.53	-66,104,335.95
本期利润	25,912,587.16	20,311,294.84	46,223,882.00
本期基金份额交易产生的变动数	-39,094,742.31	44,480,508.93	5,385,766.62
其中：基金申购款	7,883,728.14	-9,703,870.13	-1,820,141.99
基金赎回款	-46,978,470.45	54,184,379.06	7,205,908.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	268,944,067.43	-283,438,754.76	-14,494,687.33

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	210,748.29	127,297.53
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	645,319.86	1,877,874.07
其他	12,088.20	45,831.45
合计	868,156.35	2,051,003.05

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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	6,539,335,280.09	9,698,527,186.04
减：卖出股票成本总额	6,491,319,883.69	9,950,584,539.63
买卖股票差价收入	48,015,396.40	-252,057,353.59

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

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	441,692.42	40,400.05
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	441,692.42	40,400.05

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年
----	----------------------	----------------------------

	年12月31日	12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,611,057.03	216,444.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,168,400.00	176,000.00
减：应收利息总额	964.61	44.75
买卖债券差价收入	441,692.42	40,400.05

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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,430,661.12	5,734,519.12
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,430,661.12	5,734,519.12

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	20,311,294.84	-10,450,593.41
——股票投资	20,398,918.74	-10,450,593.41
——债券投资	-87,623.90	-
——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	20,311,294.84	-10,450,593.41

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	85,571.13	702,728.17
合计	85,571.13	702,728.17

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	19,769,221.49	29,117,690.96

银行间市场交易费用	-	30.50
合计	19,769,221.49	29,117,721.46

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
审计费用	70,000.00	80,000.00
信息披露费	400,000.00	400,000.00
账户维护费	31,500.00	18,000.00
银行汇划费用	4,874.43	2,455.44
上市年费	-	120,000.00
其他	200.00	200.00
合计	506,574.43	620,655.44

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 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、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构
吉林省信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国吉林森林工业集团有限责任公司	基金管理人的股东
天治北部资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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债券回购交易。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,180,009.07	8,789,261.03
其中：支付销售机构的客户维护费	1,341,116.09	1,543,866.21

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,495,835.23	1,831,096.08

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2006 年 1 月 20 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	31,904,644.10	23,089,989.01
期间申购/买入总份额	-	8,814,655.09
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	31,904,644.10	31,904,644.10
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.69%	2.31%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：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。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	46,769,754.50	210,748.29	1,276,469.47	127,297.53

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，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2017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。（2016年12月31日：同）

7.4.10.6 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。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	认购新发证券	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	认购新发证券	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	认购新发证券	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.12.2 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
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项停牌	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项停牌	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
600150	中国船舶	2017年9月27日	重大事项停牌	24.67	-	-	20,100	590,968.44	495,867.00	-
600309	万华化学	2017年12月5日	重大事项停牌	37.94	-	-	530,000	20,844,463.40	20,108,200.00	-
601600	中国铝业	2017年9月12日	重大事项停牌	6.67	2018年2月26日	7.28	4,160,000	27,400,668.79	27,747,200.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通

过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产

的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	46,769,754.50	-	-	-	-	-	46,769,754.50
结算备付金	6,930,977.61	-	-	-	-	-	6,930,977.61
存出保证金	671,261.59	-	-	-	-	-	671,261.59
交易性金融资 产	-	-	-	1,833,376.10	-	558,539,172.38	560,372,548.48
应收利息	-	-	-	-	-	13,896.12	13,896.12
应收申购款	-	-	-	-	-	8,543.50	8,543.50

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	54,371,993.70	-	-	-1,833,376.10	-	-558,561,612.00	614,766,981.80
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,213,708.39	10,213,708.39
应付赎回款	-	-	-	-	-	416,036.02	416,036.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	605,679.68	605,679.68
应付托管费	-	-	-	-	-	126,183.25	126,183.25
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,754,947.09	8,754,947.09
其他负债	-	-	-	-	-	437,787.51	437,787.51
负债总计	-	-	-	-	-	20,554,341.94	20,554,341.94
利率敏感度缺口	54,371,993.70	-	-	-1,833,376.10	-	-538,007,270.06	594,212,639.86
上年度末 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	1,276,469.47	-	-	-	-	-	1,276,469.47
结算备付金	65,606,395.76	-	-	-	-	-	65,606,395.76
存出保证金	936,049.69	-	-	-	-	-	936,049.69
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-489,534,026.65	489,534,026.65
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	30,000,165.00	30,000,165.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	65,039,333.24	65,039,333.24
应收利息	-	-	-	-	-	24,113.99	24,113.99
应收申购款	-	-	-	-	-	25,498.52	25,498.52
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	67,818,914.92	-	-	-	-	-584,623,137.40	652,442,052.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	147,672.20	147,672.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	669,377.16	669,377.16
应付托管费	-	-	-	-	-	139,453.56	139,453.56
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,082,848.48	10,082,848.48
其他负债	-	-	-	-	-	547,577.44	547,577.44
负债总计	-	-	-	-	-	11,586,928.84	11,586,928.84
利率敏感度缺口	67,818,914.92	-	-	-	-	-573,036,208.56	640,855,123.48

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末和上年度末本基金均未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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	558,539,172.38	94.00	489,534,026.65	76.39
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,833,376.10	0.31	-	-
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	560,372,548.48	94.31	489,534,026.65	76.39

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准变动+5%	51,365,124.62	43,760,380.08

	业绩比较基准变动-5%	-51,365,124.62	-43,760,380.08
--	-------------	----------------	----------------

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

7.4.14 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 2017 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 510,060,150.43 元，属于第二层次的余额为人民币 50,312,398.05 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（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 489,534,026.65 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 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 2018 年 3 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	558,539,172.38	90.85
	其中：股票	558,539,172.38	90.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,833,376.10	0.30
	其中：债券	1,833,376.10	0.30
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	53,700,732.11	8.74
8	其他各项资产	693,701.21	0.11
9	合计	614,766,981.80	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	33,251,000.00	5.60
B	采矿业	25,125,438.70	4.23
C	制造业	363,262,842.81	61.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	11,290,576.00	1.90
F	批发和零售业	3,030,000.00	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	4,552,957.94	0.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	746,399.75	0.13
J	金融业	80,081,008.18	13.48
K	房地产业	18,636.00	0.00
L	租赁和商务服务业	25,380,546.60	4.27

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.01
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	11,751,300.00	1.98
S	综合	-	-
	合计	558,539,172.38	94.00

8.2.2 报告期末按行业分类的港股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	000063	中兴通讯	1,165,952	42,394,014.72	7.13
2	601600	中国铝业	4,160,000	27,747,200.00	4.67
3	601888	中国国旅	584,940	25,380,546.60	4.27
4	601952	苏垦农发	1,467,953	20,742,175.89	3.49
5	600309	万华化学	530,000	20,108,200.00	3.38
6	002456	欧菲科技	905,000	18,633,950.00	3.14
7	300136	信维通信	357,000	18,099,900.00	3.05
8	600036	招商银行	609,859	17,698,108.18	2.98
9	002035	华帝股份	581,888	17,538,104.32	2.95
10	000858	五粮液	218,000	17,413,840.00	2.93
11	600487	亨通光电	409,901	16,568,198.42	2.79
12	601398	工商银行	2,550,000	15,810,000.00	2.66
13	600028	中国石化	2,509,990	15,386,238.70	2.59
14	000998	隆平高科	550,000	14,146,000.00	2.38
15	600038	中直股份	285,000	13,261,050.00	2.23
16	600507	方大特钢	993,605	12,608,847.45	2.12
17	601318	中国平安	180,000	12,596,400.00	2.12
18	002343	慈文传媒	330,000	11,751,300.00	1.98
19	600703	三安光电	450,000	11,425,500.00	1.92
20	000001	平安银行	850,000	11,305,000.00	1.90
21	000568	泸州老窖	170,000	11,220,000.00	1.89
22	603843	正平股份	760,000	11,149,200.00	1.88

23	000651	格力电器	240,000	10,488,000.00	1.77
24	300470	日机密封	265,290	10,266,723.00	1.73
25	002041	登海种业	780,000	10,023,000.00	1.69
26	601288	农业银行	2,570,000	9,843,100.00	1.66
27	000333	美的集团	175,000	9,700,250.00	1.63
28	603993	洛阳钼业	1,380,000	9,494,400.00	1.60
29	300498	温氏股份	380,000	9,082,000.00	1.53
30	600782	新钢股份	1,335,500	8,787,590.00	1.48
31	600584	长电科技	389,900	8,316,567.00	1.40
32	600426	华鲁恒升	500,000	7,960,000.00	1.34
33	600031	三一重工	780,000	7,074,600.00	1.19
34	600016	民生银行	800,000	6,712,000.00	1.13
35	600519	贵州茅台	9,000	6,277,410.00	1.06
36	002415	海康威视	160,000	6,240,000.00	1.05
37	000725	京东方 A	1,060,000	6,137,400.00	1.03
38	601166	兴业银行	360,000	6,116,400.00	1.03
39	600019	宝钢股份	650,000	5,616,000.00	0.95
40	600808	马钢股份	1,330,000	5,492,900.00	0.92
41	600595	中孚实业	880,000	4,708,000.00	0.79
42	601006	大秦铁路	500,000	4,535,000.00	0.76
43	600282	南钢股份	900,000	4,356,000.00	0.73
44	600967	内蒙一机	350,000	4,217,500.00	0.71
45	002271	东方雨虹	101,500	4,055,940.00	0.68
46	601933	永辉超市	300,000	3,030,000.00	0.51
47	000425	徐工机械	500,000	2,315,000.00	0.39
48	300310	宜通世纪	50,000	579,500.00	0.10
49	002798	帝王洁具	10,000	551,100.00	0.09
50	000807	云铝股份	50,000	511,500.00	0.09
51	600150	中国船舶	20,100	495,867.00	0.08
52	300203	聚光科技	10,000	355,500.00	0.06
53	002008	大族激光	6,000	296,400.00	0.05
54	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.05
55	601225	陕西煤业	30,000	244,800.00	0.04
56	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.03
57	002648	卫星石化	9,940	165,004.00	0.03
58	002241	歌尔股份	9,104	157,954.40	0.03
59	601800	中国交建	11,045	141,376.00	0.02
60	600522	中天科技	9,950	138,703.00	0.02
61	600388	龙净环保	7,943	137,413.90	0.02

62	300098	高新兴	9,984	132,787.20	0.02
63	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.01
64	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.01
65	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.01
66	300730	科创信息	821	34,112.55	0.01
67	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.01
68	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.00
69	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
70	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.00
71	000002	万科 A	600	18,636.00	0.00
72	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.00
73	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
74	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
75	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
76	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601688	华泰证券	170,970,102.28	26.68
2	600068	葛洲坝	127,828,845.75	19.95
3	000933	神火股份	105,221,232.09	16.42
4	603993	洛阳钼业	98,661,916.83	15.40
5	002456	欧菲科技	90,078,739.92	14.06
6	601669	中国电建	89,858,083.34	14.02
7	601398	工商银行	89,063,743.74	13.90
8	000063	中兴通讯	87,400,223.72	13.64
9	000651	格力电器	86,518,793.90	13.50
10	002241	歌尔股份	82,913,412.79	12.94
11	000898	鞍钢股份	82,031,623.47	12.80
12	600019	宝钢股份	76,391,865.56	11.92
13	600028	中国石化	74,772,608.21	11.67
14	601600	中国铝业	73,404,082.09	11.45

15	600109	国金证券	72,251,320.65	11.27
16	601888	中国国旅	71,302,447.70	11.13
17	600782	新钢股份	70,047,535.46	10.93
18	600309	万华化学	68,349,495.99	10.67
19	000728	国元证券	67,760,039.99	10.57
20	601288	农业银行	66,842,881.00	10.43
21	601800	中国交建	62,207,368.26	9.71
22	000807	云铝股份	62,073,702.82	9.69
23	002648	卫星石化	58,948,636.38	9.20
24	000333	美的集团	58,792,205.53	9.17
25	600507	方大特钢	57,930,602.00	9.04
26	600038	中直股份	55,759,582.38	8.70
27	000776	广发证券	52,975,992.53	8.27
28	601186	中国铁建	52,564,977.30	8.20
29	002475	立讯精密	52,301,528.50	8.16
30	601939	建设银行	52,230,393.25	8.15
31	600426	华鲁恒升	50,394,227.50	7.86
32	600967	内蒙一机	49,888,461.66	7.78
33	600963	岳阳林纸	48,338,610.69	7.54
34	000717	韶钢松山	48,290,954.57	7.54
35	600497	驰宏锌锗	48,082,838.60	7.50
36	601899	紫金矿业	47,431,839.98	7.40
37	000786	北新建材	47,351,770.79	7.39
38	600808	马钢股份	47,245,786.14	7.37
39	600820	隧道股份	46,629,938.31	7.28
40	002573	清新环境	46,353,095.65	7.23
41	000928	中钢国际	44,506,112.40	6.94
42	601611	中国核建	43,963,608.36	6.86
43	600036	招商银行	43,805,764.08	6.84
44	600030	中信证券	43,369,260.46	6.77
45	603589	口子窖	42,615,376.95	6.65
46	000065	北方国际	42,426,023.94	6.62
47	600801	华新水泥	41,169,231.25	6.42
48	002035	华帝股份	40,465,789.24	6.31
49	601117	中国化学	40,452,399.00	6.31
50	601668	中国建筑	40,348,408.11	6.30

51	000826	启迪桑德	39,677,653.94	6.19
52	600362	江西铜业	39,425,075.61	6.15
53	601952	苏垦农发	39,383,630.31	6.15
54	300136	信维通信	38,975,041.97	6.08
55	601166	兴业银行	38,746,279.40	6.05
56	603609	禾丰牧业	37,922,206.32	5.92
57	600547	山东黄金	37,080,814.35	5.79
58	600703	三安光电	36,325,313.43	5.67
59	600176	中国巨石	36,023,213.82	5.62
60	600585	海螺水泥	36,016,202.79	5.62
61	600089	特变电工	35,336,940.71	5.51
62	000858	五粮液	34,843,304.24	5.44
63	600584	长电科技	34,570,609.82	5.39
64	000709	河钢股份	34,024,169.00	5.31
65	000725	京东方 A	33,643,643.14	5.25
66	000998	隆平高科	32,267,102.80	5.04
67	600489	中金黄金	32,223,864.20	5.03
68	600487	亨通光电	31,879,817.90	4.97
69	600409	三友化工	31,865,962.04	4.97
70	601318	中国平安	31,814,128.00	4.96
71	601333	广深铁路	31,799,109.05	4.96
72	601857	中国石油	31,289,263.40	4.88
73	600029	南方航空	31,156,079.00	4.86
74	600282	南钢股份	31,087,687.23	4.85
75	000568	泸州老窖	30,194,493.50	4.71
76	600482	中国动力	30,040,222.91	4.69
77	600031	三一重工	30,013,838.63	4.68
78	000401	冀东水泥	30,002,197.26	4.68
79	300310	宜通世纪	29,069,549.37	4.54
80	300059	东方财富	29,009,066.16	4.53
81	000060	中金岭南	28,208,828.16	4.40
82	000822	山东海化	28,094,719.97	4.38
83	600643	爱建集团	27,261,861.35	4.25
84	300203	聚光科技	27,187,932.48	4.24
85	002041	登海种业	27,161,328.23	4.24
86	601006	大秦铁路	26,771,038.65	4.18

87	601992	金隅股份	25,887,116.11	4.04
88	600383	金地集团	25,580,981.37	3.99
89	300422	博世科	25,306,207.19	3.95
90	600871	石化油服	24,974,658.00	3.90
91	600522	中天科技	24,963,251.00	3.90
92	601211	国泰君安	24,464,817.65	3.82
93	300335	迪森股份	24,369,874.70	3.80
94	600884	杉杉股份	23,928,786.92	3.73
95	002271	东方雨虹	23,507,695.96	3.67
96	601666	平煤股份	22,706,279.36	3.54
97	000975	银泰资源	22,588,140.59	3.52
98	600138	中青旅	22,514,828.72	3.51
99	600125	铁龙物流	22,247,515.07	3.47
100	300470	日机密封	22,241,035.77	3.47
101	002497	雅化集团	22,127,245.74	3.45
102	300498	温氏股份	22,036,327.35	3.44
103	601225	陕西煤业	21,722,524.38	3.39
104	600388	龙净环保	21,525,760.66	3.36
105	002236	大华股份	21,296,311.62	3.32
106	002024	苏宁云商	21,296,038.00	3.32
107	601766	中国中车	21,290,561.10	3.32
108	000930	中粮生化	21,157,616.06	3.30
109	600685	中船防务	20,882,938.44	3.26
110	000018	神州长城	20,606,595.20	3.22
111	601111	中国国航	20,587,937.89	3.21
112	000002	万科 A	20,307,233.88	3.17
113	000878	云南铜业	20,174,640.44	3.15
114	002185	华天科技	20,089,631.20	3.13
115	600887	伊利股份	19,771,159.00	3.09
116	000963	华东医药	19,473,937.00	3.04
117	600048	保利地产	19,470,271.50	3.04
118	002343	慈文传媒	19,067,566.10	2.98
119	600188	兖州煤业	19,039,955.44	2.97
120	601377	兴业证券	18,985,515.97	2.96
121	002368	太极股份	18,746,774.00	2.93
122	600688	上海石化	18,618,381.80	2.91

123	002597	金禾实业	18,426,641.06	2.88
124	600018	上港集团	18,271,741.40	2.85
125	002460	赣锋锂业	18,139,614.40	2.83
126	601801	皖新传媒	17,911,639.26	2.79
127	600150	中国船舶	17,727,228.67	2.77
128	002304	洋河股份	17,569,659.24	2.74
129	600999	招商证券	17,389,812.05	2.71
130	300137	先河环保	17,338,342.00	2.71
131	000338	潍柴动力	17,332,498.00	2.70
132	002466	天齐锂业	17,327,958.00	2.70
133	000983	西山煤电	17,246,689.97	2.69
134	002230	科大讯飞	17,047,493.23	2.66
135	600115	东方航空	16,938,637.00	2.64
136	002051	中工国际	16,926,310.04	2.64
137	300098	高新兴	16,697,642.72	2.61
138	002798	帝王洁具	16,603,644.52	2.59
139	600596	新安股份	16,456,304.60	2.57
140	600595	中孚实业	16,404,361.66	2.56
141	300055	万邦达	16,358,592.00	2.55
142	002110	三钢闽光	16,230,108.65	2.53
143	600016	民生银行	16,128,675.56	2.52
144	002027	分众传媒	15,667,791.00	2.44
145	600233	圆通速递	15,324,668.32	2.39
146	600499	科达洁能	15,253,480.29	2.38
147	000157	中联重科	14,991,547.88	2.34
148	000666	经纬纺机	14,899,527.68	2.32
149	002092	中泰化学	14,781,017.41	2.31
150	600977	中国电影	14,691,068.00	2.29
151	000830	鲁西化工	14,539,487.49	2.27
152	600056	中国医药	14,120,577.48	2.20
153	601989	中国重工	13,697,377.79	2.14
154	000761	本钢板材	13,676,196.03	2.13
155	600893	航发动力	13,397,990.89	2.09
156	002415	海康威视	13,347,272.00	2.08
157	601118	海南橡胶	13,306,256.51	2.08
158	002500	山西证券	13,090,794.28	2.04

159	600562	国睿科技	12,922,707.80	2.02
-----	--------	------	---------------	------

注：表中“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601688	华泰证券	208,992,784.20	32.61
2	600068	葛洲坝	124,311,971.24	19.40
3	000933	神火股份	104,375,634.28	16.29
4	603993	洛阳钼业	98,269,118.00	15.33
5	601669	中国电建	96,727,128.93	15.09
6	002241	歌尔股份	95,162,734.48	14.85
7	601800	中国交建	80,690,935.17	12.59
8	002456	欧菲科技	78,608,452.56	12.27
9	000898	鞍钢股份	78,215,300.83	12.20
10	600820	隧道股份	77,320,226.09	12.07
11	000651	格力电器	76,408,857.64	11.92
12	601398	工商银行	75,441,265.36	11.77
13	000776	广发证券	73,602,996.48	11.49
14	000063	中兴通讯	73,365,074.22	11.45
15	000728	国元证券	71,556,787.18	11.17
16	600019	宝钢股份	69,991,789.64	10.92
17	600109	国金证券	67,279,654.76	10.50
18	600782	新钢股份	63,424,865.12	9.90
19	600028	中国石化	62,663,972.53	9.78
20	601186	中国铁建	58,696,877.78	9.16
21	002648	卫星石化	58,434,125.91	9.12
22	600547	山东黄金	57,656,576.75	9.00
23	601288	农业银行	57,429,900.00	8.96
24	601888	中国国旅	56,872,611.60	8.87
25	600309	万华化学	55,732,791.24	8.70
26	601939	建设银行	55,050,133.96	8.59
27	601899	紫金矿业	54,765,220.00	8.55
28	000333	美的集团	54,607,084.44	8.52
29	000786	北新建材	54,006,219.96	8.43
30	002475	立讯精密	52,621,962.45	8.21
31	600489	中金黄金	51,498,579.96	8.04

32	000807	云铝股份	49,790,821.46	7.77
33	600507	方大特钢	49,593,639.49	7.74
34	600963	岳阳林纸	49,225,942.98	7.68
35	601600	中国铝业	49,151,782.55	7.67
36	600497	驰宏锌锗	48,770,476.84	7.61
37	000928	中钢国际	45,930,938.40	7.17
38	002573	清新环境	45,759,317.27	7.14
39	601668	中国建筑	45,693,776.24	7.13
40	000717	韶钢松山	45,223,216.62	7.06
41	600030	中信证券	44,915,696.36	7.01
42	600967	内蒙一机	44,886,361.73	7.00
43	600801	华新水泥	44,641,136.90	6.97
44	600482	中国动力	44,357,081.99	6.92
45	600038	中直股份	44,320,688.98	6.92
46	002051	中工国际	43,743,788.69	6.83
47	600426	华鲁恒升	43,181,973.68	6.74
48	603589	口子窖	42,752,970.66	6.67
49	600808	马钢股份	41,842,735.49	6.53
50	600362	江西铜业	40,121,761.70	6.26
51	000826	启迪桑德	39,047,532.95	6.09
52	000065	北方国际	38,990,793.13	6.08
53	600999	招商证券	38,926,834.50	6.07
54	603609	禾丰牧业	38,484,486.89	6.01
55	000998	隆平高科	37,562,378.83	5.86
56	601611	中国核建	36,801,660.08	5.74
57	600089	特变电工	35,420,741.90	5.53
58	600585	海螺水泥	35,360,141.14	5.52
59	600176	中国巨石	35,235,539.32	5.50
60	000930	中粮生化	34,650,684.90	5.41
61	601989	中国重工	34,318,687.00	5.36
62	000401	冀东水泥	34,084,151.42	5.32
63	000709	河钢股份	33,965,669.98	5.30
64	600409	三友化工	33,594,474.11	5.24
65	601117	中国化学	32,542,685.00	5.08
66	601166	兴业银行	32,436,937.00	5.06
67	002434	万里扬	31,642,972.44	4.94
68	601766	中国中车	31,248,874.71	4.88
69	002041	登海种业	31,205,155.79	4.87

70	601333	广深铁路	31,194,531.50	4.87
71	601857	中国石油	30,744,744.00	4.80
72	300059	东方财富	30,507,282.12	4.76
73	600029	南方航空	30,336,233.60	4.73
74	000725	京东方 A	30,008,500.00	4.68
75	000060	中金岭南	29,571,623.75	4.61
76	600643	爱建集团	28,614,911.00	4.47
77	000822	山东海化	28,458,946.00	4.44
78	300310	宜通世纪	27,932,225.87	4.36
79	601992	金隅股份	27,734,848.83	4.33
80	601211	国泰君安	27,658,821.06	4.32
81	600036	招商银行	27,230,444.68	4.25
82	600887	伊利股份	27,036,812.68	4.22
83	601118	海南橡胶	27,007,613.16	4.21
84	600884	杉杉股份	26,849,628.31	4.19
85	600282	南钢股份	26,633,889.10	4.16
86	002497	雅化集团	26,388,904.38	4.12
87	600584	长电科技	26,037,062.07	4.06
88	002035	华帝股份	25,871,334.79	4.04
89	300335	迪森股份	25,105,631.36	3.92
90	600522	中天科技	25,066,542.00	3.91
91	600383	金地集团	24,997,543.93	3.90
92	300203	聚光科技	24,402,925.34	3.81
93	601666	平煤股份	23,904,064.51	3.73
94	600871	石化油服	23,874,552.00	3.73
95	600703	三安光电	23,633,162.39	3.69
96	600031	三一重工	23,617,409.00	3.69
97	300422	博世科	23,268,875.79	3.63
98	000858	五粮液	22,532,919.87	3.52
99	002501	利源精制	22,481,876.48	3.51
100	600138	中青旅	22,436,733.40	3.50
101	601006	大秦铁路	22,422,980.05	3.50
102	002236	大华股份	22,053,108.00	3.44
103	002110	三钢闽光	21,963,336.60	3.43
104	300136	信维通信	21,482,347.82	3.35
105	000983	西山煤电	21,250,735.96	3.32
106	000975	银泰资源	21,249,839.17	3.32
107	000963	华东医药	21,129,003.00	3.30

108	601225	陕西煤业	21,102,474.00	3.29
109	600388	龙净环保	21,082,844.14	3.29
110	000568	泸州老窖	20,875,970.66	3.26
111	002185	华天科技	20,850,450.94	3.25
112	000018	神州长城	20,801,085.24	3.25
113	000002	万科 A	20,615,376.80	3.22
114	600685	中船防务	20,374,240.56	3.18
115	000878	云南铜业	20,328,244.00	3.17
116	601111	中国国航	19,940,353.16	3.11
117	600188	兖州煤业	19,882,382.99	3.10
118	002024	苏宁云商	19,860,601.98	3.10
119	601318	中国平安	19,844,760.00	3.10
120	600125	铁龙物流	19,636,345.96	3.06
121	300137	先河环保	19,474,051.48	3.04
122	601377	兴业证券	19,338,677.60	3.02
123	600737	中粮糖业	19,035,104.11	2.97
124	600598	北大荒	18,871,071.47	2.94
125	002460	赣锋锂业	18,825,181.00	2.94
126	600048	保利地产	18,775,771.34	2.93
127	002271	东方雨虹	18,659,859.00	2.91
128	600688	上海石化	18,365,630.68	2.87
129	002368	太极股份	18,354,644.00	2.86
130	002230	科大讯飞	18,136,598.00	2.83
131	002466	天齐锂业	18,135,250.54	2.83
132	600018	上港集团	18,107,582.15	2.83
133	002597	金禾实业	17,794,103.38	2.78
134	600487	亨通光电	17,653,546.66	2.75
135	601952	苏垦农发	17,638,127.75	2.75
136	002304	洋河股份	17,539,455.00	2.74
137	601801	皖新传媒	17,379,722.00	2.71
138	300055	万邦达	17,028,119.00	2.66
139	000338	潍柴动力	17,000,235.56	2.65
140	600115	东方航空	16,749,986.00	2.61
141	000830	鲁西化工	16,689,275.68	2.60
142	601198	东兴证券	16,440,308.95	2.57
143	600233	圆通速递	15,956,764.50	2.49
144	002027	分众传媒	15,632,412.85	2.44
145	600596	新安股份	15,551,335.72	2.43

146	600499	科达洁能	15,518,019.00	2.42
147	300098	高新兴	15,359,503.00	2.40
148	002092	中泰化学	15,085,555.00	2.35
149	002798	帝王洁具	15,021,357.00	2.34
150	600150	中国船舶	14,900,592.06	2.33
151	600977	中国电影	14,609,789.00	2.28
152	000666	经纬纺机	14,574,381.40	2.27
153	600056	中国医药	14,557,826.12	2.27
154	600893	航发动力	14,534,722.60	2.27
155	000157	中联重科	14,506,029.00	2.26
156	600562	国睿科技	13,924,163.76	2.17
157	002500	山西证券	12,909,602.27	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,539,926,110.68
卖出股票收入（成交）总额	6,539,335,280.09

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,833,376.10	0.31
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,833,376.10	0.31

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132013	17 宝武 EB	14,740	1,433,759.80	0.24
2	132011	17 浙报 EB	3,340	291,916.00	0.05
3	132012	17 巨化 EB	1,130	107,700.30	0.02

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

万华化学集团股份有限公司 2017 年 7 月 6 日发布《万华化学集团股份有限公司关于 2016 年 9 月 20 日安全事故调查结果的公告》，披露 2016 年 9 月 20 日 17 时 22 分，万华化学集团股份有

限公司烟台工业园在大修停车处理过程中，MDI（二苯基甲烷二异氰酸酯）装置光化工序一台 12.1 立方米粗 MDI（以下简称粗 M）缓冲罐发生爆炸，造成 4 人死亡、4 人受伤，直接经济损失 573.62 万元。根据烟台市人民政府批复的《万华化学集团股份有限公司烟台工业园“9.20”较大爆炸事故调查报告》的建议，公司对 9 名相关责任人给予相应责任追究，包括解除劳动合同、撤职、留厂查看、降级、记过、警告等处分；烟台市安监局对万华化学集团股份有限公司负责人处上一年收入 40%的罚款，对万华化学集团股份有限公司处以 80 万元罚款。

本基金投资有关证券的投资决策程序符合法律法规及公司内部制度的相关规定。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	671,261.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,896.12
5	应收申购款	8,543.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	693,701.21

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	601600	中国铝业	27,747,200.00	4.67	重大事项停牌
2	600309	万华化学	20,108,200.00	3.38	重大事项停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
56,792	20,914.30	34,023,398.60	2.86%	1,153,741,551.79	97.14%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	天治基金管理有限公司	31,904,644.10	2.69%
2	白庆荣	2,794,057.32	0.24%
3	陈瑞荣	2,631,700.00	0.22%
4	刘志斌	2,461,578.50	0.21%
5	王明瑞	2,226,022.00	0.19%
6	林少佳	2,224,125.25	0.19%
7	黄素芝	1,980,740.27	0.17%
8	徐恒	1,877,496.35	0.16%
9	丁志杰	1,676,392.46	0.14%
10	黄萍	1,391,602.98	0.12%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	175,653.60	0.01%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年1月20日）基金份额总额	313,493,538.86
本报告期期初基金份额总额	1,379,484,993.00
本报告期基金总申购份额	38,977,965.09
减:本报告期基金总赎回份额	230,698,007.70
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,187,764,950.39

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，经天治基金管理有限公司董事会审议通过，免去闫译文女士公司副总经理职务、聘任徐克磊先生担任公司总经理职务。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，本基金管理人分别于 2017 年 5 月 2 日及 2017 年 7 月 21 日在指定媒体及公司网站上刊登了相关公告。

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

报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来，未变更过会计师事务所。

本报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬为 7 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 2006 年 1 月 20 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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受监管部门处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单 元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
国金证券	1	1,438,645,914.15	11.00%	1,339,811.63	11.10%	-
光大证券	2	1,211,860,254.17	9.27%	1,114,668.53	9.23%	-
东方证券	1	1,112,824,181.87	8.51%	1,014,117.95	8.40%	-
天风证券	2	967,577,171.52	7.40%	892,700.59	7.40%	-
兴业证券	1	884,530,143.49	6.77%	823,763.38	6.82%	-
华创证券	1	851,549,749.63	6.51%	776,017.47	6.43%	-
国融证券	1	814,317,527.74	6.23%	758,371.70	6.28%	-
齐鲁证券	2	781,830,049.81	5.98%	728,117.60	6.03%	-
长江证券	2	752,763,161.10	5.76%	697,968.56	5.78%	-
东北证券	1	644,503,898.20	4.93%	587,336.59	4.87%	-
西南证券	1	612,352,585.15	4.68%	558,037.22	4.62%	-
国泰君安	1	449,947,471.71	3.44%	419,034.97	3.47%	-
西藏东方财富 证券	2	328,995,059.25	2.52%	306,392.88	2.54%	-
国信证券	1	307,584,616.13	2.35%	280,302.19	2.32%	-
华金证券	1	304,382,076.53	2.33%	283,471.75	2.35%	-
东兴证券	1	288,468,962.56	2.21%	262,881.32	2.18%	-
海通证券	1	288,460,291.17	2.21%	268,644.98	2.23%	-
申银万国	1	254,454,595.83	1.95%	236,972.62	1.96%	-
川财证券	2	237,491,564.46	1.82%	220,413.33	1.83%	-
招商证券	1	136,704,498.81	1.05%	127,313.75	1.05%	-
安信证券	1	132,709,087.76	1.02%	123,592.20	1.02%	-
方正证券	1	114,881,336.84	0.88%	104,691.31	0.87%	-
民生证券	1	95,144,601.32	0.73%	88,608.76	0.73%	-

广发证券	1	61,125,614.67	0.47%	56,926.03	0.47%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券（原名远东	1	-	-	-	-	-
银行国联证券	1	-	-	-	-	-

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

2、基金专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

3、报告期内本基金新增西藏东财、五矿证券、华金证券、国融证券上海交易单元，新增西藏东财、西南证券深圳交易单元；报告期内本基金退租长城证券、中信建投、中国中投上海交易单元，退租长城证券、国泰君安深圳交易单元。

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
国金证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	50,000,000.00	100.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	934,554.90	16.66%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	787,188.48	14.03%	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	3,088,970.00	55.06%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	172,890.00	3.08%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	539,391.00	9.61%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	87,681.20	1.56%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券 (原名远东)	-	-	-	-	-	-
银行国联证 券	1	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

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 2016 年 12 月 31 日基金净值公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 1 月 3 日
2	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持中鼎股份股票估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 1 月 17 日
3	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）2016 年第 4 季度报告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 1 月 20 日
4	天治基金管理有限公司旗下开放	上证报、中证报、证	2017 年 2 月 23 日

	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	券时报、证券日报	
5	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书摘要（2017 年第 1 次更新）	上证报、中证报、券时报、证券日报	2017 年 3 月 3 日
6	天治基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加宜信普泽费率优惠活动的公告	上证报、中证报、券时报、证券日报	2017 年 3 月 10 日
7	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）2016 年年度报告摘要	上证报、中证报、券时报、证券日报	2017 年 3 月 30 日
8	天治基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	上证报、中证报、券时报、证券日报	2017 年 4 月 17 日
9	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）2017 年第 1 季度报告	上证报、中证报、券时报、证券日报	2017 年 4 月 21 日
10	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	上证报、中证报、券时报、证券日报	2017 年 4 月 24 日
11	天治基金管理有限公司高级管理 人员变更公告	上证报、中证报、券时报、证券日报	2017 年 5 月 2 日
12	天治基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券网上交易费率优惠活动的公告	上证报、中证报、券时报、证券日报	2017 年 5 月 19 日
13	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持欧菲光股票估值方法的公告	上证报、中证报、券时报、证券日报	2017 年 6 月 8 日
14	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银	上证报、中证报、券时报、证券日报	2017 年 7 月 1 日

	行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告		
15	天治基金管理有限公司 2017 年 6 月 30 日基金净值公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 7 月 3 日
16	天治基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 7 月 4 日
17	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基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 7 月 4 日
18	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持爱建集团股票估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 7 月 8 日
19	天治基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 7 月 21 日
20	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）2017 年第 2 季度报告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 7 月 21 日
21	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加华泰证券基金申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 7 月 31 日
22	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持三钢闽光股票估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 8 月 9 日
23	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加上海联泰资产管理有限公司为代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 8 月 10 日
24	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）2017 年半年度报告摘	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 8 月 28 日

	要		
25	关于深圳腾元基金销售有限公司终止代销天治基金管理有限公司旗下基金的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 8 月 31 日
26	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书摘要（2017 年第 2 次）	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 9 月 2 日
27	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 9 月 12 日
28	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持中国铝业股票估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 9 月 19 日
29	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加上海有鱼基金销售有限公司为代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 9 月 20 日
30	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）2017 年第 3 季度报告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 10 月 26 日
31	天治基金管理有限公司关于旗下基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 11 月 15 日
32	天治基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 11 月 29 日
33	天治基金管理有限公司关于调整旗下证券投资基金持有流通受限股票估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 12 月 14 日

34	关于天治基金管理有限公司旗下基金缴纳增值税的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 12 月 30 日
35	天治基金管理有限公司旗下部分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	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 12 月 30 日
36	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加浙商银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2017 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准天治核心成长混合型证券投资基金募集的文件
2. 《天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
3. 《天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》
4. 《天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）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. 报告期内天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）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

天治基金管理有限公司

2018 年 3 月 29 日