

天治鑫利纯债债券型证券投资基金（原天
治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金
基金转型）
2019 年年度报告

2019 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：2020 年 4 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 2020 年 4 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。

天治鑫利纯债债券型证券投资基金的报告期自 2019 年 3 月 7 日（基金转型生效日）起至 12 月 31 日止；原天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 6 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	6
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）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	12
3.2 基金净值表现（转型前）.....	16
3.3 其他指标.....	20
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	20
§4 管理人报告	21
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	21
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	22
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	22
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.....	24
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	24
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	25
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	26
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	27
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.....	27
§5 托管人报告	28
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	28
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.....	28
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.....	28
§6 审计报告（转型后）	29
6.1 审计报告基本信息.....	29
6.2 审计报告的基本内容.....	29
§6 审计报告（转型前）	32
6.1 审计报告基本信息.....	32
6.2 审计报告的基本内容.....	32
§7 年度财务报表（转型后）	35
7.1 资产负债表（转型后）.....	35
7.2 利润表.....	36
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	37
7.4 报表附注.....	38
§7 年度财务报表（转型前）	61

7.1 资产负债表（转型前）	61
7.2 利润表	62
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	63
7.4 报表附注	64
§8 投资组合报告（转型后）	90
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	90
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	90
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	90
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	91
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	91
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	91
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	91
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	91
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	91
8.11 投资组合报告附注	92
§8 投资组合报告（转型前）	93
8.1 期末基金资产组合情况	93
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	93
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	93
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	94
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	94
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	94
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	94
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	94
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	94
8.11 投资组合报告附注	95
§9 基金份额持有人信息（转型后）	96
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	96
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	96
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	97
§9 基金份额持有人信息（转型前）	98
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	98
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	98
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	98
§ 10 开放式基金份额变动(转型后)	100
§ 10 开放式基金份额变动(转型前)	101
§11 重大事件揭示	102
11.1 基金份额持有人大会决议	102
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	102
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	102
11.4 基金投资策略的改变	102
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	103
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	103

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	103
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）	108
11.9 其他重大事件（转型前）	111
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	113
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	113
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	113
§13 备查文件目录.....	114
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	天治鑫利纯债债券型证券投资基金	
基金简称	天治鑫利纯债债券	
基金主代码	003123	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年3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	5,020,964.10份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天治鑫利纯债债券 A	天治鑫利纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	003123	003124
报告期末下属分级基金的份额总额	5,004,721.90份	16,242.20份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	天治鑫利半年定期开放	
基金主代码	003123	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12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	10,120,014.16份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天治鑫利 A	天治鑫利 C
下属分级基金的交易代码	003123	003124
报告期末下属分级基金的份额总额	10,053,620.54份	66,393.62份

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	在严格控制风险的前提下追求基金资产长期稳健增值，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，对宏观经济运行趋势、财政以及货币政策变化趋势作出分析和判断，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，确定本基金债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析和严格的风险控制基础上，综合考虑经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响，深入挖掘价值被低估的标的券种。
业绩比较基准	中证全债指数收益率

风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低预期收益和预期风险的产品。
--------	--

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	在严格控制风险的前提下追求基金资产长期稳健增值，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>(1) 封闭期投资策略</p> <p>在本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配的基础上，通过自上而下的定性分析和定量分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。</p> <p>(2) 开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	6 个月定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中等预期收益和预期风险的产品。

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
	联系电话	021-60371155
	电子邮箱	zhaozz@chinanature.com.cn
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	上海市复兴西路 159 号	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200031	200336
法定代表人	单宇	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
----------------	---------

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）	上海市浦东新区世纪大道 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	2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	天治鑫利纯债债券 A	天治鑫利纯债债券 C
本期已实现收益	-31,721.27	576.76
本期利润	27,878.77	-174.83
加权平均基金份额本期利润	0.0041	-0.0051
本期加权平均净值利润率	0.39%	-0.49%
本期基金份额净值增长率	1.06%	1.16%
3.1.2 期末数据和指标	2019年12月31日	
期末可供分配利润	316,713.21	891.38
期末可供分配基金份额利润	0.0633	0.0549
期末基金资产净值	5,321,435.11	17,133.58
期末基金份额净值	1.0633	1.0549
3.1.3 累计期末指标	2019年12月31日	
基金份额累计净值增长率	1.06%	1.16%

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

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

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

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年1月1日至2019年3月6日		2018年		2017年	
	天治鑫利 A	天治鑫利 C	天治鑫利 A	天治鑫利 C	天治鑫利 A	天治鑫利 C
本	646,628.83	2,532.98	1,526,032.06	15,438.73	5,256,294.57	163,048.9

期已实现收益						9
本期利润	169,278.12	1,372.55	1,959,397.96	19,571.59	5,132,960.46	159,472.30
加权平均基金份额本期利润	0.0070	0.0083	0.0462	0.0401	0.0217	0.0194
本期加权平均净值利润率	0.66%	0.80%	4.48%	3.92%	2.14%	1.92%
本期基金份额净值增长率	0.01%	-0.08%	4.44%	4.01%	0.52%	0.16%
3.1.	2019年3月6日		2018年末			2017年末

2						
期 末 数 据 和 指 标						
期末可供分配利润	524,079.53	2,839.45	630,366.17	6,751.76	3,756,098.68	118,216.90
期末可供分配基金份额利润	0.0521	0.0428	0.0119	0.0144	0.1087	0.2313
期末基金资产净值	10,577,700.07	69,233.07	55,779,230.66	487,803.97	34,811,431.27	512,921.49
期末基金份额净值	1.0521	1.0428	1.0520	1.0436	1.0073	1.0034
3.1.	2019年3月6日		2018年末		2017年末	

3 累 计 期 末 指 标						
基金份 额累 计净 值增 长率	5.21%	4.28%	5.20%	4.36%	0.73%	0.34%

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

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

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

3.2 基金净值表现（转型后）

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

天治鑫利纯债债券 A

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	0.51%	0.12%	1.31%	0.04%	-0.80%	0.08%
过去六个月	2.19%	0.14%	2.83%	0.04%	-0.64%	0.10%
自基金合同 生效起至今	1.06%	0.15%	4.03%	0.05%	-2.97%	0.10%

天治鑫利纯债债券 C

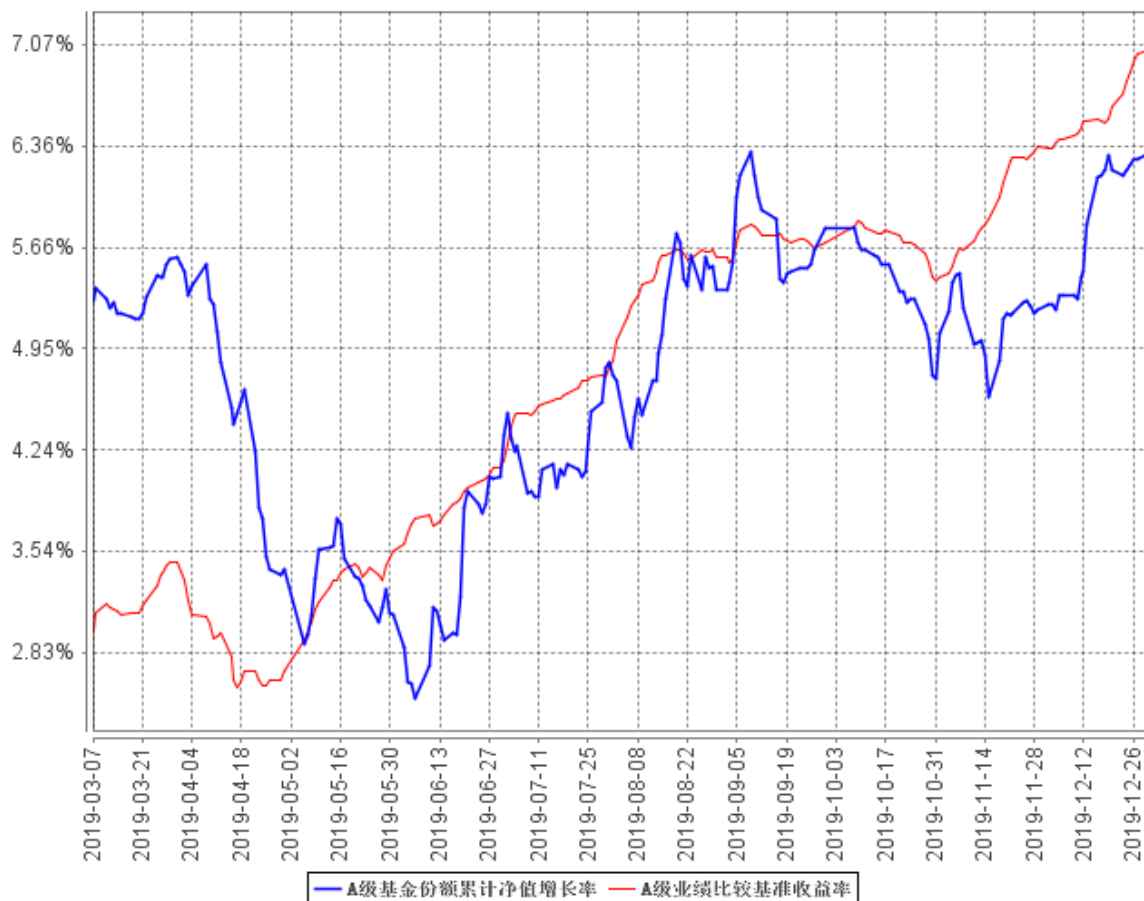
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.41%	0.12%	1.31%	0.04%	-0.90%	0.08%

过去六个月	2.45%	0.15%	2.83%	0.04%	-0.38%	0.11%
自基金合同生效起至今	1.16%	0.16%	4.03%	0.05%	-2.87%	0.11%

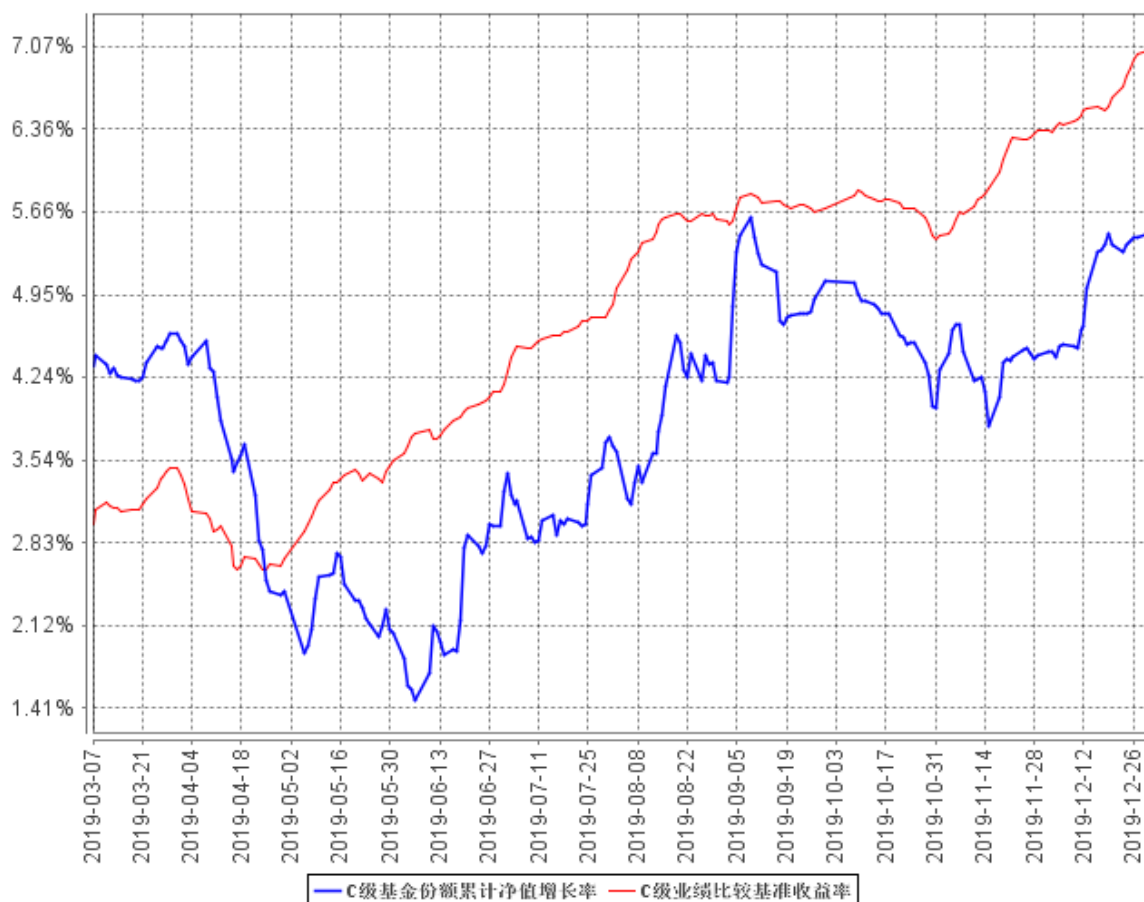
注：自基金合同生效起至今为 2019 年 3 月 7 日-2019 年 12 月 31 日。

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

A级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



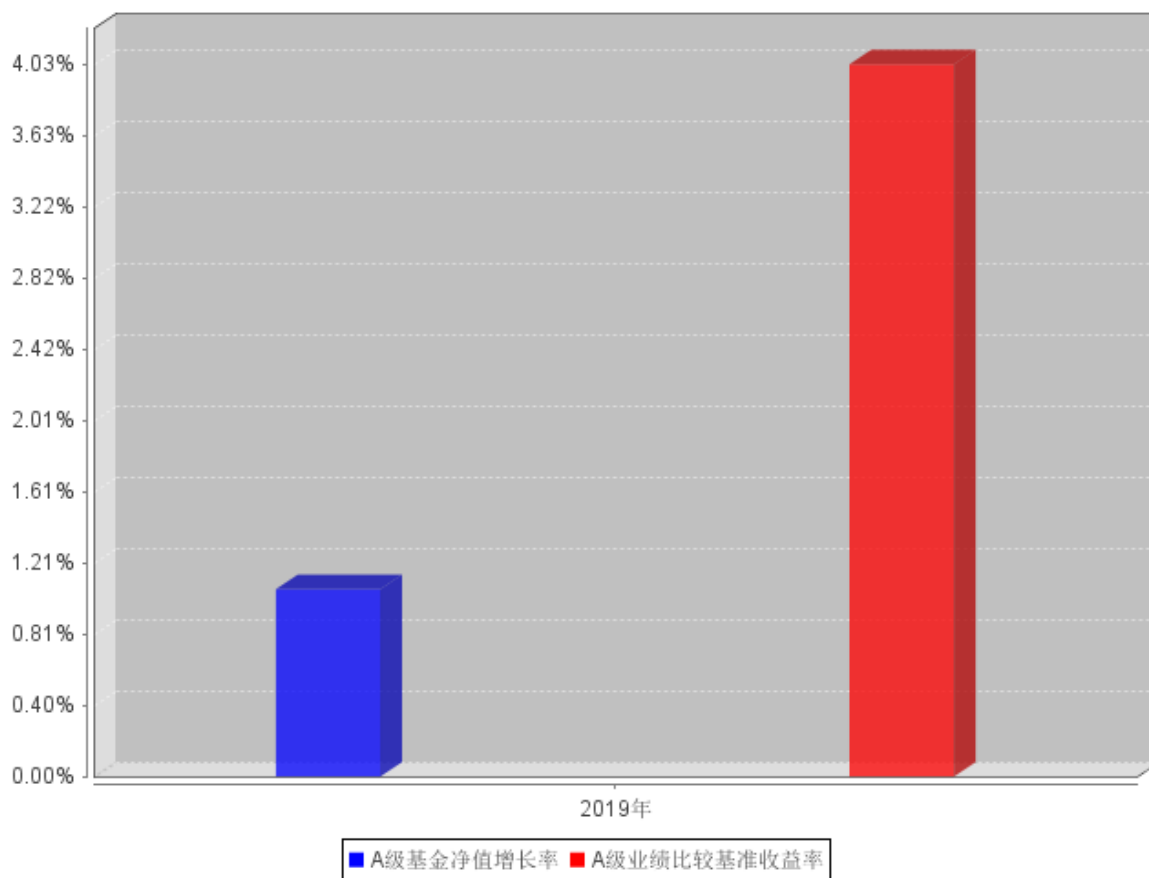
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



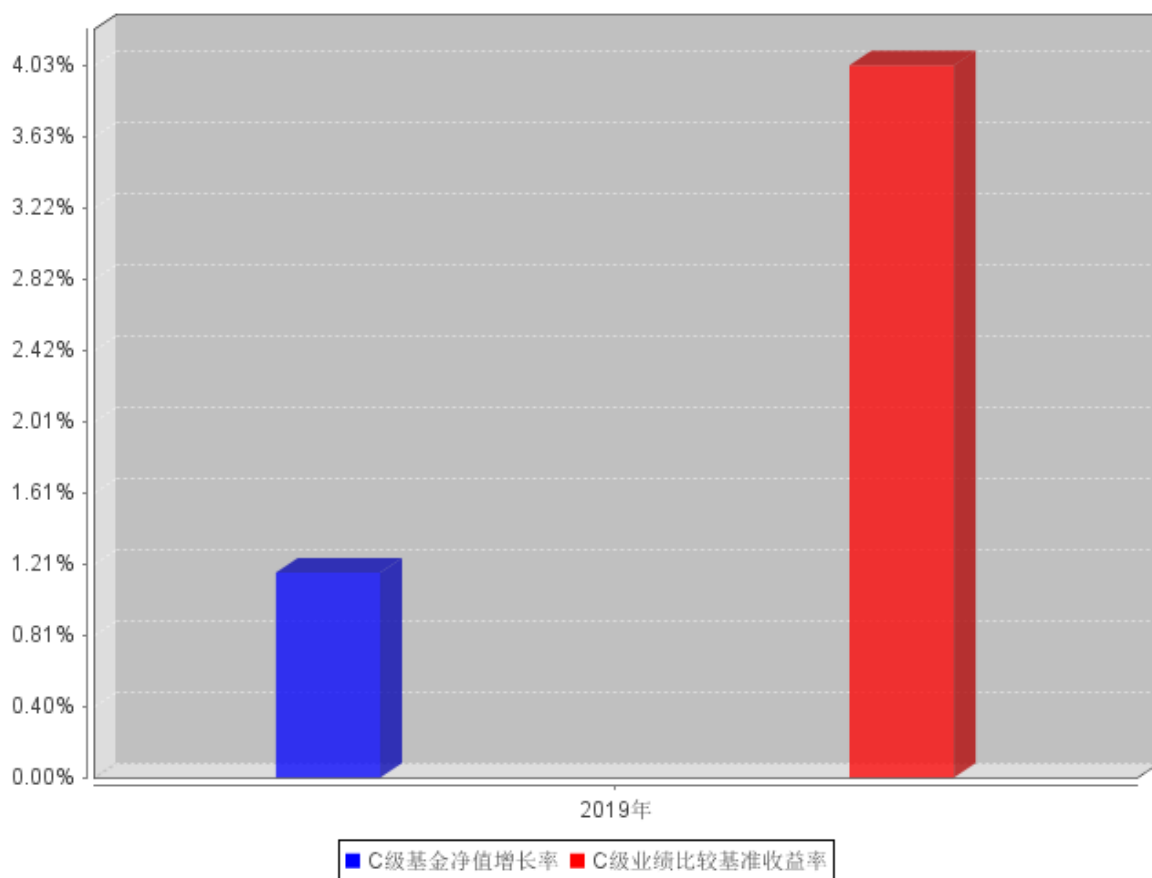
注：本基金于 2019 年 3 月 7 日由原天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型而来。

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

A级自基金合同生效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对比图



C级自基金合同生效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对比图



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

天治鑫利 A

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	0.34%	0.09%	0.32%	0.00%	0.02%	0.09%
过去六个月	1.61%	0.07%	0.64%	0.00%	0.97%	0.07%
过去一年	3.48%	0.06%	1.30%	0.00%	2.18%	0.06%
自基金合同生效起至今	5.21%	0.07%	2.92%	0.00%	2.29%	0.07%

天治鑫利 C

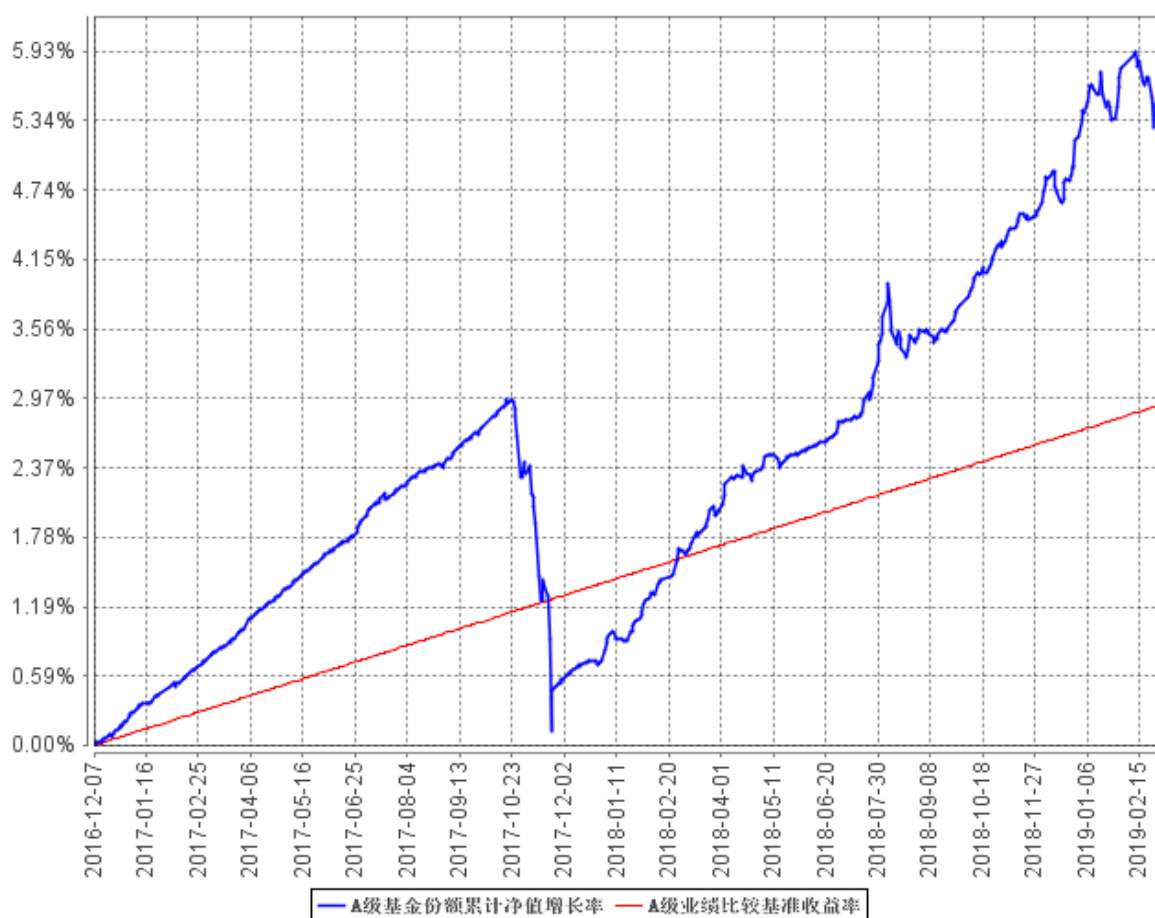
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.23%	0.09%	0.32%	0.00%	-0.09%	0.09%

过去六个月	1.39%	0.06%	0.64%	0.00%	0.75%	0.06%
过去一年	3.04%	0.06%	1.30%	0.00%	1.74%	0.06%
自基金合同生效起至今	4.28%	0.07%	2.92%	0.00%	1.36%	0.07%

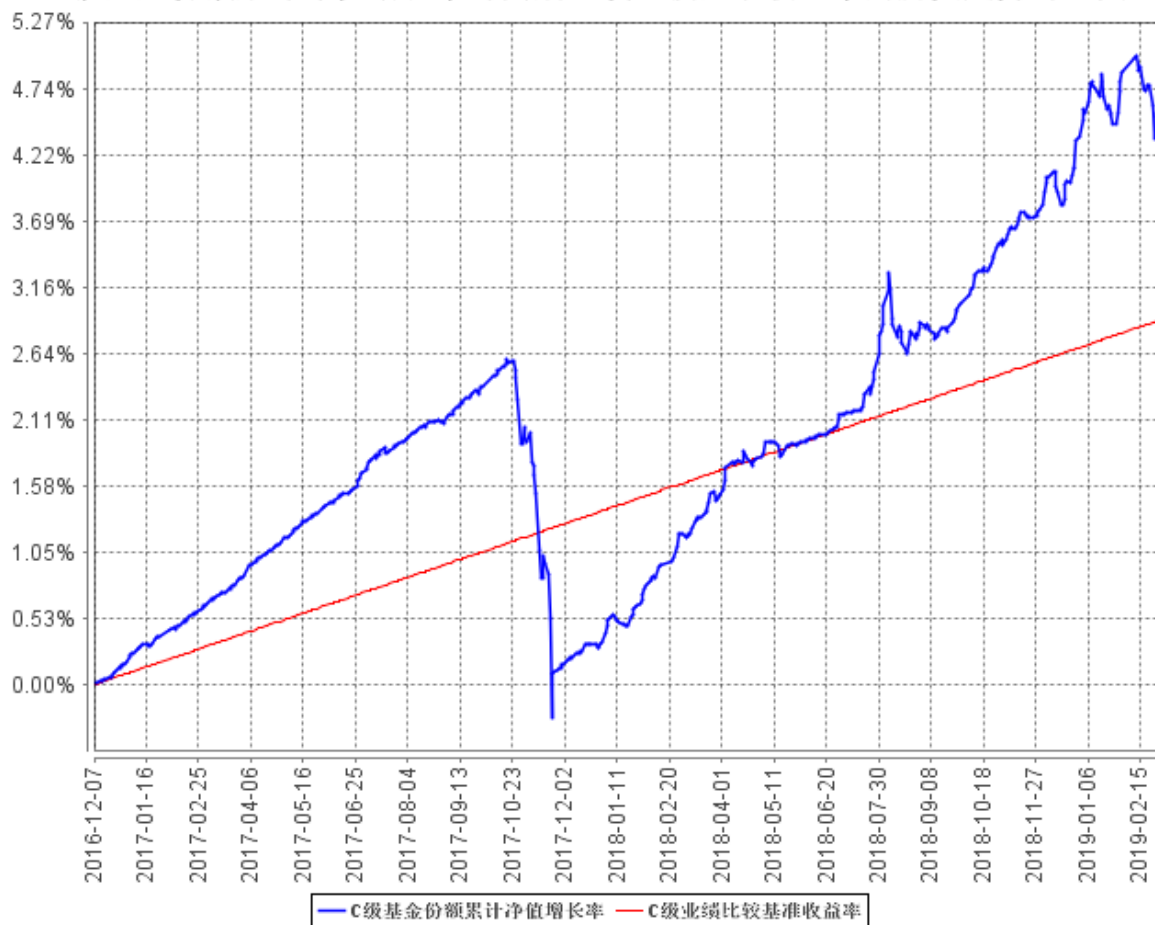
注：自基金合同生效起至今为 2016 年 12 月 7 日-2019 年 3 月 6 日。

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

A级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

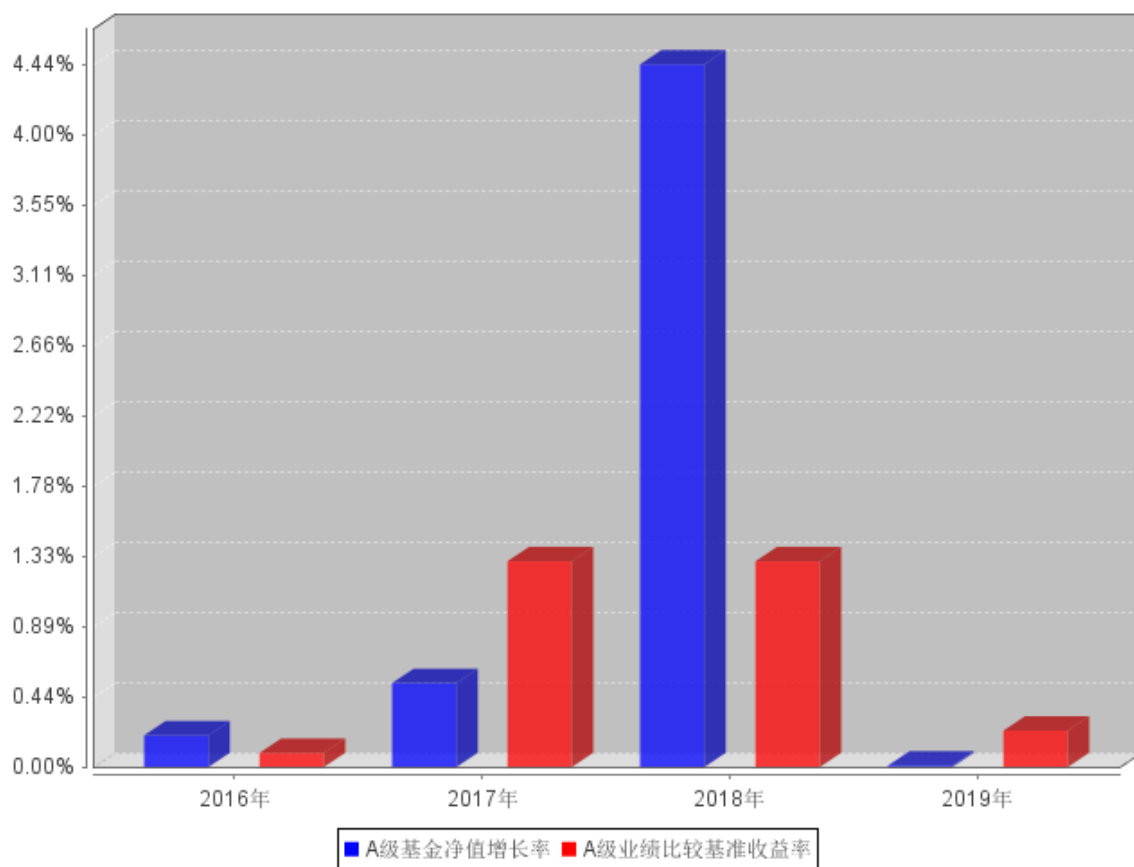


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

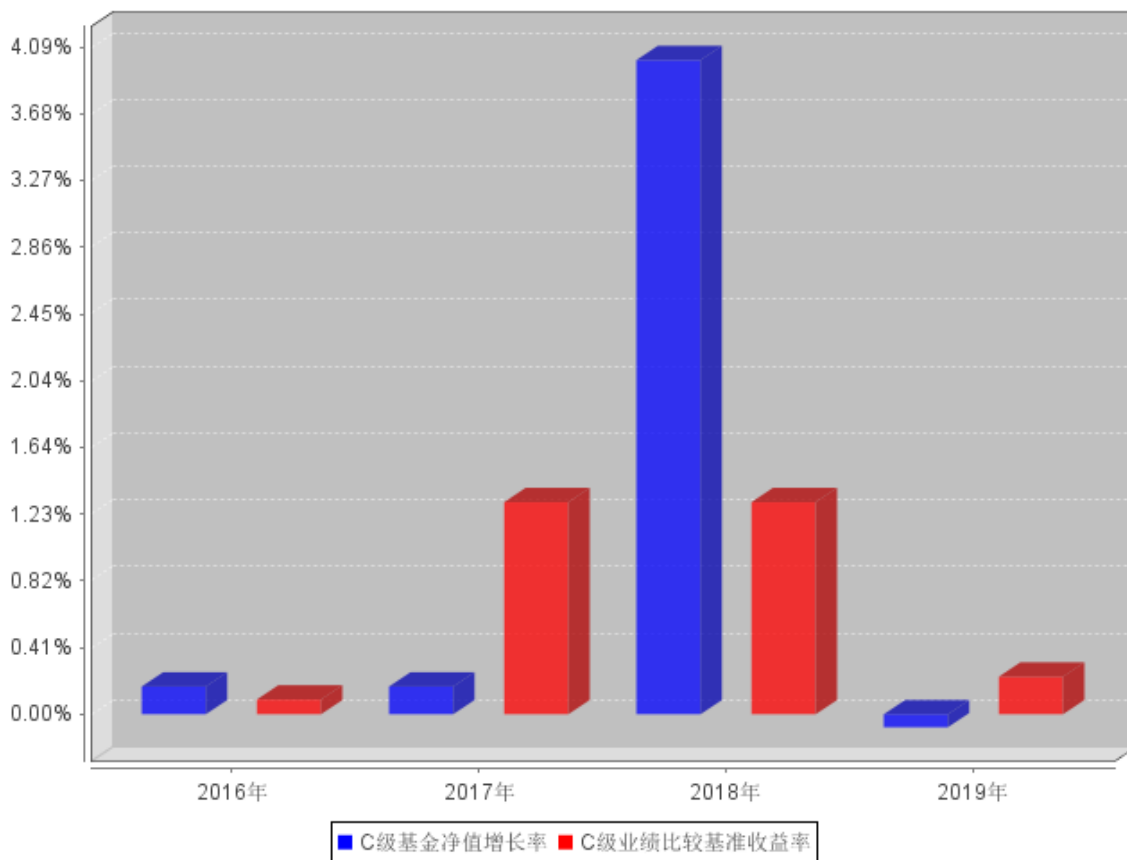


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效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对比图



C级自基金合同生效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

转型前

注：本基金过去三年未进行利润分配。

转型后

注：本基金自 2019 年 3 月 7 日至 2019 年 12 月 31 日止未进行利润分配。

§ 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 2019 年 12 月 31 日，本基金管理人旗下共有十四只开放式基金，除本基金外，另外十三只基金——天治财富增长证券投资基金、天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）、天治天得利货币市场基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、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）、天治转型升级混合型证券投资基金、天治量化核心精选混合型证券投资基金、天治稳健双鑫债券型证券投资基金分别于 2004 年 6 月 29 日、2006 年 1 月 20 日、2006 年 7 月 5 日、2008 年 11 月 5 日、2009 年 7 月 15 日、2013 年 6 月 4 日、2015 年 6 月 9 日、2016 年 4 月 7 日、2016 年 4 月 18 日、2016 年 7 月 6 日、2019 年 5 月 21 日、2019 年 6 月 11 日、2019 年 11 月 20 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		
郝杰	本基金基金经理、天治天得利货币市场基金基金经理	2019 年 9 月 4 日	-	8 年	管理学学士，具有基金从业资格。曾任长信基金管理有限公司基金会计、上海浦银安盛资产管理有限公司运营专员、中海基金管理有限公司高级债券交易员。
向桂英	本基金基金经理、天治天得利货币市场基金基金经理	2016 年 12 月 23 日	2019 年 9 月 16 日	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司交易员、交易部副总监。

注：1、基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离任日期为公司对外公告的离任日期；

非首任基金经理，任职日期和离任日期分别为公司对外公告的任职日期和离任日期。

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		
向桂英	本基金基金经理、天治天得利货币市场基金基金经理	2016年12月23日	2019年9月16日	8年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司交易员、交易部副总监。

注：1、基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离任日期为公司对外公告的离任日期；

非首任基金经理，任职日期和离任日期分别为公司对外公告的任职日期和离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》、《天治鑫利纯债债券型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产，为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度。并在交易系统中设置公平

交易功能并严格执行，即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，交易系统将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合。

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

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

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

具体方法如下：

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

报告期内，本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年我国经济仍处于下行区间，GDP 增速从一季度的 6.4%到四季度的 6.0%持续下滑。投资方面，固定资产投资全年呈下行趋势，制造业投资增速不断下滑，基建投资发力不及预期，房地产投资韧性较强；消费方面，全年消费累计增速出现小幅回落，主要受汽车拖累略显疲软；出口方面，受中美贸易摩擦和全球经济发展放缓影响，外需明显下滑，出口增速回落。通胀方面，受猪周期影响，下半年 CPI 一直处于高位，这主要源于食品项的推动，非食品项贡献率呈下降趋势，结构性通胀对货币政策宽松制约有限。货币政策方面，央行运用多种货币政策工具保持银行体系流动性合理充裕，通过 LPR 改革促进货币政策机制的疏通，加强逆周期调节，货币政策全年呈现稳健中性的态势。

报告期内，本基金结合市场情况进行资产配置，适时调整组合久期和各类资产的配置比例，力争控制回撤，为持有人带来稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日（转型后报告期末），本基金 A 类份额净值为 1.0633 元，C 类份额净值为 1.0549 元；自 2019 年 3 月 7 日（基金转型生效日）至转型后报告期末，本基金 A 类份额净值增长率为 1.06%，业绩比较基准收益率为 4.03%，低于同期业绩比较基准收益率 2.97%；C 类份额净值增长率为 1.16%，业绩比较基准收益率为 4.03%，低于同期业绩比较基准收益率 2.87%。

截至 2019 年 3 月 6 日（转型前报告期末），本基金 A 类份额净值为 1.0521 元，C 类份额净值为 1.0428 元；转型前报告期末前三个月，本基金 A 类份额净值增长率为 0.34%，业绩比较基准收益率为 0.32%，高于同期业绩比较基准收益率 0.02%；C 类份额净值增长率为 0.23%，业绩比较基准收益率为 0.32%，低于同期业绩比较基准收益率 0.09%。

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 2020 年，经济下行压力依然存在，政府逆周期调节力度将进一步加大，经济有望企稳。投资方面，新增专项债的额度大概率较 2019 年上行，将对基建走势起到支撑作用，有助于经济企稳；受政策影响，房地产销售同比增速连续多月为负，但施工增速稳中有升，且销售开始转正，预计 2020 年政府将更加审慎的推进房地产调控政策，表现可能与 2019 年持平；随着中美贸易摩擦缓和加上制造业可能进入补库存周期，制造业投资有望提升。消费方面，汽车销售跌幅不断减小，加之随着后续汽车支持政策的不断落实，汽车销售将不再对社零总额增速形成拖累；此外，房地产政策将在“房住不炒”和“因城施策”之间寻求平衡，若政策边际宽松，房地产销售将持

续改善，进而带动家具家电、装修类消费的回升。出口方面，中美正式签署第一阶段贸易协议，贸易摩擦短期缓解，将在一定程度上提升进口和出口的增长，对拉动经济有一定帮助；但中美第二阶段贸易谈判的不确定性和全球经济延续疲软态势，将为 2020 年进出口带来不利影响。

货币政策方面，面对经济下行压力，央行预计采取稳健的货币政策，同时强调相机抉择和灵活应变。为降低小微企业融资成本，央行将灵活运用结构性货币政策，还可能会通过降息降准的方式提供资金支持，确保经济的平稳运行。

债券市场方面，当前的基本面和货币政策都有利于债券利率进一步走低，长端利率债仍有下行空间，但 2020 年上半年由于地方债大量供给，加上利率水平已经处于历史低位和风险偏好的上升，债市可能存在一定承压。整体来看，2020 年长端利率债大概率维持区间震荡为主。由于货币政策的宽松预期，短端债券利率中枢大概率下移。

基于以上展望，本基金将继续保持稳健的投资原则，加强组合的流动性管理，适时调整组合久期和各类资产配置比例，为投资者获取与风险相匹配的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2019 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，公司进一步完善了管理制度，制定或修订了《天治基金廉洁从业管理制度》、《天治基金银行间交易对手管理制度》、《天治基金洗钱风险管理制度》、《天治基金信息技术管理制度》、《天治基金固有资金运用管理制度》、《天治基金信息披露制度》、《天治基金关联交易管理办法》、《天治基金公开募集证券投资基金信息披露工作细则》、《天治基金基金敏感信息知情人登记制度》、《天治基金通信管理制度》、《天治基金反洗钱工作管理制度》、《天治基金监察稽核部管理制度》、《天治基金合规管理实施细则》、《天治基金洗钱风险识别与评估制度》、《天治基金客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理制度》、《天治基金洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理制度》、《天治基金大额交易和可疑交易报告制度》、《天治基金涉及恐怖活动资产冻结管理制度》、《天治基金反洗钱工作信息管理制度》、《天治基金反洗钱培训与宣传管理制度》、《天治基金反洗钱检查和审计制度》、《天治基金反洗钱自评估管理制度》、《天治基金重大洗钱风险应急计划》、《天治基金企业文化建设制度》、《天治基金信息技术应急管理制度》、《天治基金风险管理制度》等规章制度，有效保障了公司相关机构职能的发挥及业务的发展。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，同时产品开发与金融工程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。基金会计均具备基金从业资格。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、产品开发与金融工程部总监等，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、量化投资部、固定收益部以及产品开发与金融工程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，与产品开发与金融工程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

报告期内本基金未进行利润分配，符合相关法律法规和基金合同的规定。

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

转型前，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元、基金持有人数少于 200 人的情形，出现上述情形的时间段为 2019 年 1 月 15 日至 2019 年 3 月 6 日。

转型后，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元、基金持有人数少于 200 人的情形，出现上述情形的时间段为 2019 年 3 月 7 日至 2019 年 12 月 31 日。本基金管理人已于 2019 年 6 月 10 日向中国证监会报告了相关事宜及解决方案。

§ 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

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（2020）审字第 60467615_B14 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	天治鑫利纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了天治鑫利纯债债券型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年 3 月 7 日（基金合同转型日）至 2019 年 12 月 31 日止期间的利润表、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，后附的天治鑫利纯债债券型证券投资基金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，公允反映了天治鑫利纯债债券型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 3 月 7 日（基金合同转型日）至 2019 年 12 月 31 日止期间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，我们独立于天治鑫利纯债债券型证券投资基金，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>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>天治鑫利纯债债券型证券投资基金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。</p> <p>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	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

责任	<p>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鑫利纯债债券型证券投资基金的持续经营能力，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鑫利纯债债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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。</p> <p>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，就可能导致对天治鑫利纯债债券型证券投资基金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</p>

	<p>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能导致天治鑫利纯债债券型证券投资基金不能持续经营。</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 沈熙苑
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	2020 年 4 月 27 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（2020）审字第 60467615_B02 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	天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 3 月 6 日的资产负债表，2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日止期间的利润表、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，后附的天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金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，公允反映了天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金 2019 年 3 月 6 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日止期间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，我们独立于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金，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>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金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。</p> <p>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</p>

	<p>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鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的持续经营能力，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鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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。</p> <p>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，就可能导致对天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金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</p>

	<p>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能导致天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金不能持续经营。</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 沈熙苑
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	2020 年 4 月 27 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：天治鑫利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	48,324.04
结算备付金		29,876.54
存出保证金		1,444.45
交易性金融资产	7.4.7.2	5,193,548.50
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		5,193,548.50
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		2,000.00
应收利息	7.4.7.5	109,469.99
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		5,384,663.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 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		2,000.00
应付赎回款		-
应付管理人报酬		3,177.01
应付托管费		907.70
应付销售服务费		5.89
应付交易费用	7.4.7.7	-
应交税费		4.23
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	40,000.00
负债合计		46,094.83
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	5,020,964.10
未分配利润	7.4.7.10	317,604.59
所有者权益合计		5,338,568.69
负债和所有者权益总计		5,384,663.52

注：（1）报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0633 元，基金份额总额 5,020,964.10 份，其中 A 类基金份额净值 1.0633 元，份额总额 5,004,721.90 份；C 类基金份额净值 1.0549 元，份额总额 16,242.20 份。

（2）本基金由天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型而成，基金合同转型日为 2019 年 3 月 7 日。

7.2 利润表

会计主体：天治鑫利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		148,711.43
1. 利息收入		170,550.99
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,171.30
债券利息收入		163,776.65
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		603.04
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-80,765.97
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-80,765.97
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	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	58,848.45
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	77.96
减：二、费用		121,007.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	41,487.78
2. 托管费	7.4.10.2.2	11,853.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	122.78
4. 交易费用	7.4.7.19	833.34
5. 利息支出		3,875.56
其中：卖出回购金融资产支出		3,875.56
6. 税金及附加		21.56
7. 其他费用	7.4.7.20	62,812.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,703.94
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,703.94

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治鑫利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019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)	10,120,014.16	526,918.98	10,646,933.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,703.94	27,703.94
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)	-5,099,050.06	-237,018.33	-5,336,068.39
其中：1. 基金申购款	98,110.50	4,887.44	102,997.94
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-5,197,160.56	-241,905.77	-5,439,066.33
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)	5,020,964.10	317,604.59	5,338,568.69

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：

徐克磊闫译文黄宇星

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

天治鑫利纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型而成，天治鑫利半年定期开放债券型证券投资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[2016]1652号《关于准予天治鑫利半年定期开放债券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2016年12月7日正式生效，首次设立募集规模为435,407,203.13份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为天治基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》及《天治基金管理有限公司关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金自2019年3月7日起转型并更名为天治鑫利纯债债券型证券投资基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券（含非公开发行公司债券）、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债、证券公司发行的短期公司债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中小企业私募债券等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票、权证等资产。本基金通过可分离交易可转债认购所获得的认股权证，在其可上市交易后10个交易日内全部卖出。本基金所持可转换债券转股获得的股票在其可上市交易后的10个交易日内全部卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率。

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》、《公开募集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〈年度报告和中期报告〉》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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2019 年 3 月 7 日（基金合同转型日）起至 2019 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，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2019 年 3 月 7 日（基金合同转型日）起至 2019 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债券投资等；

(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债券等，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，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) 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；

(2) 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)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；

(6) 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;

(7) 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;

(8) 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) 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;

(2) 基金收益分配后各类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;

(3) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同;本基金同一基金份额类别内的每份基金份额享有同等分配权;

(4) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 分部报告

-

7.4.4.13 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 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，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

7.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业

费附加的单位外) 及地方教育费附加。

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[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[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。

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 2019 年 12 月 31 日
活期存款	48,324.04
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	48,324.04

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券 交易所市场	5,188,013.23	5,193,548.50	5,535.27

	银行间市场	-	-	-
	合计	5,188,013.23	5,193,548.50	5,535.27
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,188,013.23	5,193,548.50	5,535.27

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

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 2019年12月31日
应收活期存款利息	99.39
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	13.42
应收债券利息	109,356.58
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.60
合计	109,469.99

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

注：本基金本报告期末无应付交易费用余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
----	--------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	40,000.00
预提信息披露费	-
合计	40,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

天治鑫利纯债债券 A		
项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	10,053,620.54	10,053,620.54
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	6,224.69	6,224.69
本期赎回(以“-”号填列)	-5,055,123.33	-5,055,123.33
本期末	5,004,721.90	5,004,721.90

金额单位：人民币元

天治鑫利纯债债券 C		
项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	66,393.62	66,393.62
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	91,885.81	91,885.81
本期赎回(以“-”号填列)	-142,037.23	-142,037.23
本期末	16,242.20	16,242.20

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

天治鑫利纯债债券 A			
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	728,186.78	-204,107.25	524,079.53

本期利润	-31,721.27	59,600.04	27,878.77
本期基金份额交易产生的变动数	-324,740.31	89,495.22	-235,245.09
其中：基金申购款	371.02	-0.21	370.81
基金赎回款	-325,111.33	89,495.43	-235,615.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	371,725.20	-55,011.99	316,713.21

金额单位：人民币元

天治鑫利纯债债券 C			
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	4,175.06	-1,335.61	2,839.45
本期利润	576.76	-751.59	-174.83
本期基金份额交易产生的变动数	-3,682.75	1,909.51	-1,773.24
其中：基金申购款	4,737.96	-221.33	4,516.63
基金赎回款	-8,420.71	2,130.84	-6,289.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,069.07	-177.69	891.38

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日
活期存款利息收入	5,666.96
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	456.61
其他	47.73
合计	6,171.30

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

注：本基金本报告期无股票投资收益——买卖股票差价收入。

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 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019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	-80,765.97
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	-80,765.97

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 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	52,265,696.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	51,781,376.37
减：应收利息总额	565,086.04
买卖债券差价收入	-80,765.97

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：基金本报告期无贵金属投资收益。

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

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019 年12月31日
1. 交易性金融资产	58,848.45
——股票投资	-
——债券投资	58,848.45
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	58,848.45

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年 12月31日
基金赎回费收入	77.96
合计	77.96

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日
交易所市场交易费用	333.34
银行间市场交易费用	500.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	833.34

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日
审计费用	32,876.65
信息披露费	-
账户维护费	27,000.00
银行汇划费用	2,036.16
其他	900.00
合计	62,812.81

7.4.7.21 分部报告

-

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（“天治基金”）	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（“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

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：本基金本报告期无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
	2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	41,487.78
其中：支付销售机构的客户维护费	23,542.81

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.70%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，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
	2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,853.66

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

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 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天治鑫利纯债债券 A	天治鑫利纯债债券 C	合计
天治基金管理有限公司	-	8.38	8.38
交通银行股份有限公司	-	7.68	7.68
合计	-	16.06	16.06

注：A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times C \text{ 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。于次月首日起 3 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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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**

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

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 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	48,324.04	5,666.96

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2019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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

-

7.4.11 利润分配情况**7.4.11.1 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。

7.4.12 期末（2019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

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券	证券	成功	可流通	流通受限	认购	期末估值	数量	期末	期末	说明

代码	名称	认购日	日	类型	价格	单价	(单位: 张)	成本总额	估值总额	
110063	鹰 19 转债	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 3 日	认购新发 证券	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-
110064	建工 转债	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 16 日	认购新发 证券	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-
113029	明阳 转债	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 7 日	认购新发 证券	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-
113030	东风 转债	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 20 日	认购新发 证券	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-
128088	深南 转债	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 16 日	认购新发 证券	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2019 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金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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金融资产款余额。

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。

7.4.13.3 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

金额单位：人民币元

本期末 2019 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	48,324.04	-	-	-	-	-	48,324.04
结算备付金	29,876.54	-	-	-	-	-	29,876.54
存出保证金	1,444.45	-	-	-	-	-	1,444.45
交易性金融资产	4,062,436.00	-	6,000.00	1,125,112.50	-	-	5,193,548.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,000.00	2,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	109,469.99	109,469.99
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,142,081.03	-	6,000.00	1,125,112.50	-	111,469.99	5,384,663.52
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,000.00	2,000.00

应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,177.01	3,177.01
应付托管费	-	-	-	-	-	907.70	907.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5.89	5.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	4.23	4.23
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	40,000.00	40,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	46,094.83	46,094.83
利率敏感度缺口	4,142,081.03	-	6,000.00	1,125,112.50	-	65,375.16	5,338,568.69

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

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2019年12月31日）
	利率上升 25 个基点	-4,707.63
	利率下降 25 个基点	4,707.63

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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 2019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	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	5,193,548.50	97.28
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	5,193,548.50	97.28

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（2019年12月31日）
	业绩比较基准变动+5%	106,761.04
	业绩比较基准变动-5%	-106,761.04

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2019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0.00元，属于第二层次的余额为人民币5,193,548.50元，属于第三层次的余额为人民币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 2020 年 4 月 27 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：天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 3 月 6 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 3 月 6 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	191,590.99	531,107.41
结算备付金		90,632.56	190,954.15
存出保证金		8,176.18	13,141.04
交易性金融资产	7.4.7.2	13,948,578.40	65,761,949.80
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		13,948,578.40	65,761,949.80
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	-	8,000,132.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	295,845.46	1,308,378.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		14,534,823.59	75,805,662.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 3 月 6 日	上年度末 2018 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		1,500,000.00	19,199,851.20
应付证券清算款		124,127.78	-
应付赎回款		2,212,413.24	-
应付管理人报酬		1,546.05	33,331.86
应付托管费		441.72	9,523.38
应付销售服务费		4.56	165.16
应付交易费用	7.4.7.7	1,569.25	2,110.76
应交税费		-	371.27
应付利息		664.50	13,274.70

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	47,123.35	280,000.00
负债合计		3,887,890.45	19,538,628.33
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	10,120,014.16	53,490,189.88
未分配利润	7.4.7.10	526,918.98	2,776,844.75
所有者权益合计		10,646,933.14	56,267,034.63
负债和所有者权益总计		14,534,823.59	75,805,662.96

注：报告截止日 2019 年 3 月 6 日，基金份额净值 1.0521 元，基金份额总额 10,120,014.16 份，其中 A 类基金份额净值 1.0521 元，份额总额 10,053,620.54 份；C 类基金份额净值 1.0428 元，份额总额 66,393.62 份。

7.2 利润表

会计主体：天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		262,533.13	2,972,126.43
1. 利息收入		199,172.31	1,964,152.09
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,707.92	43,672.17
债券利息收入		171,227.11	1,706,843.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,237.28	213,636.12
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		541,871.96	570,475.58
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	541,871.96	570,475.58
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	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-478,511.14	437,498.76
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	-	-

减：二、费用		91,882.46	993,156.88
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	30,860.07	310,280.62
2. 托管费	7.4.10.2.2	8,817.15	88,651.56
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	118.56	1,998.74
4. 交易费用	7.4.7.19	1,078.59	4,120.48
5. 利息支出		23,186.49	221,437.43
其中：卖出回购金融资产支出		23,186.49	221,437.43
6. 税金及附加		3.56	569.20
7. 其他费用	7.4.7.20	27,818.04	366,098.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		170,650.67	1,978,969.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		170,650.67	1,978,969.55

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 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）	53,490,189.88	2,776,844.75	56,267,034.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	170,650.67	170,650.67
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）	-43,370,175.72	-2,420,576.44	-45,790,752.16
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-43,370,175.72	-2,420,576.44	-45,790,752.16
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）	10,120,014.16	526,918.98	10,646,933.14
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	35,068,943.56	255,409.20	35,324,352.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,978,969.55	1,978,969.55
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）	18,421,246.32	542,466.00	18,963,712.32
其中：1. 基金申购款	35,022,648.82	981,875.61	36,004,524.43
2. 基金赎回款	-16,601,402.50	-439,409.61	-17,040,812.11
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）	53,490,189.88	2,776,844.75	56,267,034.63

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

天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金（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[2016]1652号《关于准予天治鑫利半年定期开放债券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2016年12月7日正式生效，首次设立募集规模为435,407,203.13份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为天治基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不直接买入股票、权证、可转换债等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他

品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；但在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期，本基金不受上述 5%的限制，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：6 个月定期存款利率（税后）。

经中国证券监督管理委员会 2018 年 12 月 19 日证监许可[2018]2109 号文变更注册，并依据 2019 年 1 月 29 日天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，本基金 2019 年 3 月 7 日转型并更名为天治鑫利纯债债券型证券投资基金，《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》自 2019 年 3 月 7 日起生效。

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》、《公开募集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〈年度报告和中期报告〉》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。

经中国证券监督管理委员会 2018 年 12 月 19 日证监许可[2018]2109 号文变更注册，并依据 2019 年 1 月 29 日天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，本基金 2019 年 3 月 7 日转型并更名为天治鑫利纯债债券型证券投资基金，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 2019 年 3 月 6 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日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，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 3 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债券投资等；

(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债券等，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，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) 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；

(2) 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) 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；

(6) 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；

(7) 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；

(8) 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) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金各类基金份额每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该类基金份额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) 基金收益分配后各类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) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；本基金同一基金份额类别内的每份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 分部报告

-

7.4.4.13 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 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，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

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[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[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。

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 2019 年 3 月 6 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	191,590.99	531,107.41
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	191,590.99	531,107.41

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 3 月 6 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,837,131.58	3,821,578.40
	银行间市场	10,164,760.00	10,127,000.00
	合计	14,001,891.58	13,948,578.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	14,001,891.58	13,948,578.40	-53,313.18
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	10,285,339.24	10,359,449.80	74,110.56
	银行间市场	55,051,412.60	55,402,500.00	351,087.40
	合计	65,336,751.84	65,761,949.80	425,197.96
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		65,336,751.84	65,761,949.80	425,197.96

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 2019年3月6日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
项目	上年度末 2018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	8,000,132.00	-
合计	8,000,132.00	-

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 2019年3月6日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	7,674.45	401.67
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	481.03	85.90
应收债券利息	287,644.07	1,291,074.31
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	16,810.78

应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	45.91	5.90
合计	295,845.46	1,308,378.56

注：此处其他列示的是应收结算保证金利息。

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 2019年3月6日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	1,569.25	2,110.76
合计	1,569.25	2,110.76

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年3月6日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提审计费	47,123.35	40,000.00
预提信息披露费	-	240,000.00
合计	47,123.35	280,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

天治鑫利 A		
项目	本期 2019年1月1日至2019年3月6日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,022,778.26	53,022,778.26
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-42,969,157.72	-42,969,157.72
- 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	10,053,620.54	10,053,620.54

金额单位：人民币元

天治鑫利 C		
项目	本期 2019年1月1日至2019年3月6日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	467,411.62	467,411.62
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-401,018.00	-401,018.00
- 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	66,393.62	66,393.62

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

天治鑫利 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,346,857.76	409,594.64	2,756,452.40
本期利润	646,628.83	-477,350.71	169,278.12
本期基金份额交易产生的变动数	-2,265,299.81	-136,351.18	-2,401,650.99
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-2,265,299.81	-136,351.18	-2,401,650.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	728,186.78	-204,107.25	524,079.53

金额单位：人民币元

天治鑫利 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,807.06	3,585.29	20,392.35
本期利润	2,532.98	-1,160.43	1,372.55
本期基金份额交易产生的变动数	-15,164.98	-3,760.47	-18,925.45
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-15,164.98	-3,760.47	-18,925.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,175.06	-1,335.61	2,839.45

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年3月 6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31 日
活期存款利息收入	7,272.78	37,394.41
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	395.13	4,943.68
其他	40.01	1,334.08
合计	7,707.92	43,672.17

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

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**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——买卖股票差价收入。

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 2019年1月1日至2019年3 月6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	541,871.96	570,475.58
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	541,871.96	570,475.58

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 2019年1月1日至2019年3 月6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	68,061,721.48	225,257,627.01
减：卖出债券（、债转股及	66,068,171.96	221,705,528.65

债券到期兑付) 成本总额		
减: 应收利息总额	1, 451, 677. 56	2, 981, 622. 78
买卖债券差价收入	541, 871. 96	570, 475. 58

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

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年3 月6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
1. 交易性金融资产	-478,511.14	437,498.76
——股票投资	-	-
——债券投资	-478,511.14	437,498.76
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-478,511.14	437,498.76

7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年3 月6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
交易所市场交易费用	16.09	592.98
银行间市场交易费用	1,062.50	3,527.50
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,078.59	4,120.48

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年3月6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
审计费用	7,123.35	40,000.00

信息披露费	-	240,000.00
账户维护费	9,000.00	36,000.00
银行汇划费用	1,394.69	8,898.85
其他	10,300.00	41,200.00
合计	27,818.04	366,098.85

7.4.7.21 分部报告

-

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（“天治基金”）	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（“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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.1 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无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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年3月6日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	30,860.07	310,280.62
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	11,250.56	111,249.77

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，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
	2019年1月1日至2019年3月6日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,817.15	88,651.56

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

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 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天治鑫利 A	天治鑫利 C	合计
天治基金管理有限公司	-	1.90	1.90
交通银行股份有限公司	-	0.65	0.65
合计	-	2.55	2.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天治鑫利 A	天治鑫利 C	合计
天治基金管理有限公司	-	5.03	5.03
交通银行股份有限公司	-	3.56	3.56
合计	-	8.59	8.59

注：A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times C$ 类基金销售服务费年费率 / 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。于次月首日起 3 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。

7.4.10.3 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

注：本基金的基金管理人于本报告期及上年度均未运用固有资金投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年3月6日		2018年1月1日至2018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	191,590.99	7,272.78	531,107.41	37,394.41

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2019年3月6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（2018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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

-

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019年3月6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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2019 年 3 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金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 3 月 6 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 1,500,000.00 元,于 2019 年 3 月 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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。

7.4.13.3 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。

本基金采用定期开放的运作方式，封闭期内不得申请申购、赎回本基金。在开放期内，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

金额单位：人民币元

本期末 2019年3 月6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	191,590.99	-	-	-	-	-	191,590.99
结算备付金	90,632.56	-	-	-	-	-	90,632.56
存出保证金	8,176.18	-	-	-	-	-	8,176.18
交易性金融资产	600,720.00	-	-	13,055,858.40	292,000.00	-	13,948,578.40
应收利息	-	-	-	-	-	295,845.46	295,845.46
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	891,119.73	-	-	13,055,858.40	292,000.00	295,845.46	14,534,823.59
负债							
卖出回购金融资产款	1,500,000.00	-	-	-	-	-	1,500,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	124,127.78	124,127.78
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,212,413.24	2,212,413.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,546.05	1,546.05
应付托管费	-	-	-	-	-	441.72	441.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4.56	4.56
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,569.25	1,569.25
应付利息	-	-	-	-	-	664.50	664.50
其他负债	-	-	-	-	-	47,123.35	47,123.35

负债总计	1,500,000.00	-	-	-	-	2,387,890.45	3,887,890.45
利率敏感度缺口	-608,880.27	-	-	-13,055,858.40	292,000.00	-2,092,044.99	10,646,933.14
上年度末 2018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	531,107.41	-	-	-	-	-	531,107.41
结算备付金	190,954.15	-	-	-	-	-	190,954.15
存出保证金	13,141.04	-	-	-	-	-	13,141.04
交易性金融资产	-5,014,500.00	11,719,800.00	47,036,226.60	1,991,423.20	-	-	-65,761,949.80
买入返售金融资产	8,000,132.00	-	-	-	-	-	8,000,132.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,308,378.56	1,308,378.56
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	8,735,334.60	5,014,500.00	11,719,800.00	47,036,226.60	1,991,423.20	1,308,378.56	75,805,662.96
负债							
卖出回购金融资产款	19,199,851.20	-	-	-	-	-	-19,199,851.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,331.86	33,331.86
应付托管费	-	-	-	-	-	9,523.38	9,523.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	165.16	165.16
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,110.76	2,110.76
应付利息	-	-	-	-	-	13,274.70	13,274.70

息							
应交税费	-	-	-	-	-	371.27	371.27
其他负债	-	-	-	-	-	280,000.00	280,000.00
负债总计	19,199,851.20	-	-	-	-	338,777.13	19,538,628.33
利率敏感度缺口	-10,464,516.60	5,014,500.00	11,719,800.00	47,036,226.60	1,991,423.20	969,601.43	56,267,034.63

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年3月6日）	上年度末（2018年12月31日）
	利率上升 25 个基点	-92,153.92	-352,881.49
	利率下降 25 个基点	92,153.92	352,881.49

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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 2019年3月6日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比	公允价值	占基金资产净值比

		例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	13,948,578.40	131.01	65,761,949.80	116.87
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	13,948,578.40	131.01	65,761,949.80	116.87

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（2019年3月6日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准变动+5%	432,321.01	1,019,605.12
	业绩比较基准变动-5%	-432,321.01	-1,019,605.12

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2019年3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0.00元，属于第二层次的余额为人民币13,948,578.40元，属于第三层次的余额为人民币0.00元（于2018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0.00元，属于第二层次的余额为人民币65,761,949.80元，属于第三层次的余额为人民币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 2020 年 4 月 27 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,193,548.50	96.45
	其中：债券	5,193,548.50	96.45
	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	78,200.58	1.45
8	其他各项资产	112,914.44	2.10
9	合计	5,384,663.52	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：无。

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

注：无。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：无。

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	5,187,548.50	97.17
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）	6,000.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,193,548.50	97.28

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019611	19 国债 01	40,600	4,062,436.00	76.10
2	010107	21 国债(7)	10,950	1,125,112.50	21.08
3	128088	深南转债	20	2,000.00	0.04
4	110063	鹰 19 转债	10	1,000.00	0.02
5	110064	建工转债	10	1,000.00	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国债期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

8.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,444.45
2	应收证券清算款	2,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	109,469.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	112,914.44

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有流通受限股票。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,948,578.40	95.97
	其中：债券	13,948,578.40	95.97
	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	282,223.55	1.94
8	其他资产	304,021.64	2.09
9	合计	14,534,823.59	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：无。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：无。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：无。

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	13,948,578.40	131.01
	其中：政策性金融债	13,948,578.40	131.01
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,948,578.40	131.01

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	180212	18 国开 12	100,000	10,127,000.00	95.12
2	018008	国开 1802	25,000	2,545,000.00	23.90
3	018005	国开 1701	6,000	600,720.00	5.64
4	018006	国开 1702	3,760	383,858.40	3.61
5	018003	国开 1401	2,500	292,000.00	2.74

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国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注**8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

8.11.3 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	8,176.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	295,845.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	304,021.64

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有流通受限股票。

8.11.6 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（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
天治鑫利纯债债券 A	83	60,297.85	0.00	0.00%	5,004,721.90	100.00%
天治鑫利纯债债券 C	52	312.35	0.00	0.00%	16,242.20	100.00%
合计	135	37,192.33	0.00	0.00%	5,020,964.10	100.00%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，计算结果保留小数点后 4 位，第 5 位四舍五入。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	天治鑫利纯债债券 A	1,842.77	0.0368%
	天治鑫利纯债债券 C	2,691.74	16.5725%
	合计	4,534.51	0.0903%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	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	天治鑫利纯债债券 A	0
	天治鑫利纯债债券 C	0~10
	合计	-
本基金基金经理持有本开 放式基金	天治鑫利纯债债券 A	0
	天治鑫利纯债债券 C	0~10
	合计	-

§ 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

份额级别	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
天治鑫利 A	143	70,305.04	-	-	10,053,620.54	100.00%
天治鑫利 C	28	2,371.20	-	-	66,393.62	100.00%
合计	171	59,181.37	-	-	10,120,014.16	100.00%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，计算结果保留小数点后 4 位，第 5 位四舍五入。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	天治鑫利 A	4,650.34	0.0463%
	天治鑫利 C	3,083.27	4.6439%
	合计	7,733.61	0.0764%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	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	天治鑫利 A	0~10
	天治鑫利 C	0~10
	合计	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	天治鑫利 A	0
	天治鑫利 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	天治鑫利纯债债券 A	天治鑫利纯债债券 C
基金合同生效日基金份额总额	10,053,620.54	66,393.62
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,224.69	91,885.81
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	5,055,123.33	142,037.23
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	5,004,721.90	16,242.20

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	天治鑫利 A	天治鑫利 C
基金合同生效日基金份额总额	420,020,531.40	15,386,671.73
本报告期期初基金份额总额	53,022,778.26	467,411.62
本报告期基金总申购份额	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	42,969,157.72	401,018.00
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	10,053,620.54	66,393.62

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

自 2018 年 12 月 26 日至 2019 年 1 月 28 日，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。本次基金份额持有人大会于 2019 年 1 月 29 日表决通过了《关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型的议案》，本次大会决议自该日起生效。本基金于 2019 年 3 月 7 日转型并更名为天治鑫利纯债债券型证券投资基金，《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》自 2019 年 3 月 7 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，经工商行政管理部门核准，天治基金管理有限公司法定代表人变更为单宇先生，本基金管理人于 2019 年 3 月 23 日在中国证券监督管理委员会指定媒介及公司网站上刊登了相关公告。

报告期内，经天治基金管理有限公司第五届董事会第四十一次会议审议通过，自 2019 年 5 月 10 日起，聘任闫译文女士担任公司副总经理，上述事项已按有关规定在中国证券投资基金业协会完成相关手续，并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案，本基金管理人于 2019 年 5 月 10 日在中国证券监督管理委员会指定媒介及公司网站上刊登了相关公告。

经天治基金管理有限公司总经理办公会决定，自 2019 年 9 月 4 日起，增聘郝杰女士担任本基金基金经理，自 2019 年 9 月 16 日起，解聘向桂英女士本基金基金经理职务。上述事项已按有关规定在中国证券投资基金业协会完成相关手续，并报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 2019 年 9 月 5 日、2019 年 9 月 17 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

本基金于 2019 年 3 月 7 日转型并更名为天治鑫利纯债债券型证券投资基金，《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》同日生效。自该日起，基金投资策略变更为“本基金充分发挥基金管理人的研究优势，对宏观经济运行趋势、财政以及货币政策变化趋势作出分析和判断，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，确定本基金债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析和严格的风险控制基础上，综合考虑经济变量的变动对不同券种收

益率、信用趋势和风险的潜在影响，深入挖掘价值被低估的标的券种”。

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 2016 年 12 月 7 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，管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受稽查或处罚。

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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

海通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-

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
长江证券	74,118,793.86	100.00%	13,300,000.00	100.00%	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-

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

2、基金专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

3、本基金本报告期内租用券商交易单元的变更情况：新增渤海证券交易单元 1 个、新时代证券交

易单元 1 个，退租中信证券交易单元 2 个；

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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

长城证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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
长江证券	15,649,442.60	100.00%	16,400,000.00	100.00%	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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

2、基金专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

3、本基金本报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

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公司法定代表人变更的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2019年3月23日
2	天治旗下 11 只基金 2018 年年	上证报、中证报、证	2019年3月27日

	度报告汇总	券时报、证券日报	
3	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	2019年3月29日
4	天治旗下十一只基金 2019 年第 1 季度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2019年4月18日
5	天治基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京植信基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2019年4月18日
6	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	2019年5月10日
7	关于天治基金管理有限公司旗下基金暂停通过浙江金观诚基金销售有限公司办理认购、申购等业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2019年6月11日
8	天治基金管理有限公司 2019 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	2019年7月1日
9	天治旗下十一只基金 2019 年第 2 季度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2019年7月16日
10	天治基金管理有限公司关于旗下部分基金参加海通证券费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2019年8月16日
11	天治基金管理有限公司关于天治鑫利纯债债券型证券投资基金增加天天基金为代销机构的公告	上证报	2019年8月19日

12	天治基金管理有限公司旗下基金增加钜派钰茂为代销机构、开通定期定额投资业务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	2019年8月22日
13	天治旗下 11 只基金 2019 年半年度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2019年8月23日
14	天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告	上证报	2019年9月5日
15	天治鑫利纯债债券型证券投资基金更新招募说明书（摘要）	上证报	2019年9月7日
16	天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告	上证报	2019年9月17日
17	天治鑫利纯债债券型证券投资基金更新招募说明书（摘要）	上证报	2019年9月18日
18	天治基金管理有限公司旗下基金增加济安财富为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务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	2019年9月20日
19	天治旗下十三只基金 2019 年第 3 季度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2019年10月25日
20	天治基金管理有限公司增加吉林银行股份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	2019年10月26日
21	天治基金管理有限公司关于旗下基金参加第一创业证券费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2019年11月13日
22	天治基金管理有限公司关于防范不法分子冒用我司名义进行	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2019年11月21日

	非法活动的特别提示公告		
23	天治基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料以免影响日常交易的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2019 年 11 月 28 日
24	天治基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同、托管协议的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2019 年 12 月 3 日
25	天治旗下十三只基金更新的招募说明书（摘要）	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2019 年 12 月 5 日
26	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、证券时报	2019 年 12 月 31 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	封闭期内天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金周净值公告	上证报、证券日报	2019 年 1 月 2 日
2	天治基金管理有限公司 2018 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	2019 年 1 月 2 日
3	封闭期内天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金周净值公告	上证报、证券日报	2019 年 1 月 7 日
4	天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的公告	上证报、证券日报	2019 年 1 月 10 日
5	封闭期内天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金周净值公告	上证报、证券日报	2019 年 1 月 14 日
6	天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金更新的招募说明书（摘要）（2019 年第 1 次更新）	上证报	2019 年 1 月 18 日
7	天治旗下十一只基金 2018 年	上证报、中证报、证	2019 年 1 月 22 日

	第 4 季度报告汇总	券时报、证券日报	
8	天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金选择期开放赎回业务的公告	上证报	2019 年 1 月 30 日
9	天治基金管理有限公司关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	上证报	2019 年 1 月 30 日
10	封闭期内天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金周净值公告	上证报	2019 年 1 月 31 日
11	天治基金管理有限公司旗下基金增加泰诚财富为代销机构、开通定期定额投资和基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	上证报、中证报、券时报、证券日报	2019 年 2 月 15 日
12	天治基金管理有限公司关于《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》生效的公告	上证报	2019 年 3 月 6 日
13	天治鑫利纯债债券型证券投资基金开放申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	上证报	2019 年 3 月 6 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190115-20190115	7,781,128.40	0.00	7,781,128.40	0.00	0.00%
	2	20190115-20190117	9,726,653.70	0.00	9,726,653.70	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金单一投资者持有的基金份额比例较高，需要保持足够好的流动性应对集中赎回情况。但本基金以流动性较好的资产为主，可及时变现，流动性风险总体可控。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金变更注册为天治鑫利纯债债券型证券投资基金的文件
2. 《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》
3. 《天治鑫利纯债债券型证券投资基金托管协议》
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照
5. 报告期内天治鑫利纯债债券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

天治基金管理有限公司

2020 年 4 月 30 日