

天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 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:2022 年 08 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。本中期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2022年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末上市基金前十名持有人	61

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
11.1 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.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 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LOF
基金主代码	163503
交易代码	163503
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2006年01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	625,036,674.08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07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股自由流通全盘指数×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
	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	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.chinanature.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街17号恒奥中心A座

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日- 2022年06月30日)
本期已实现收益	-112,014,706.74
本期利润	-84,704,034.81
加权平均基金份额本期利润	-0.1348
本期加权平均净值利润率	-21.26%
本期基金份额净值增长率	-17.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)
期末可供分配利润	73,040,848.64
期末可供分配基金份额利润	0.1169
期末基金资产净值	393,360,191.73
期末基金份额净值	0.6293
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	217.53%

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	①-③	②-④

				④		
过去一个月	13.00%	2.34%	7.13%	0.80%	5.87%	1.54%
过去三个月	-1.35%	2.01%	3.93%	1.19%	-5.28%	0.82%
过去六个月	-17.64%	1.91%	-7.04%	1.15%	-10.60%	0.76%
过去一年	-8.47%	2.02%	-5.00%	0.95%	-3.47%	1.07%
过去三年	54.05%	1.84%	22.77%	0.93%	31.28%	0.91%
自基金合同生效起至今	217.53%	1.68%	305.36%	1.27%	-87.83%	0.41%

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

天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年01月20日-2022年06月30日)



§ 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2022年6月30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）、天治鑫利纯债债券型证券投资基金（转型自2016年12月7日生效的天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金）、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、天治天享66个月定期开放债券型证券投资基金分别于2004年6月29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3月7日、2019年5月21日、2019年6月11日、2021年09月16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	公司投资总监兼权益投资部总监、本基金基金经理、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天治稳健双盈债券型证券投资基金基金经理、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015-06-02	-	17年	经济学、文学双学士，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，曾任交易员、交易部总监助理、交易部副总监、交易部总监。

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

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 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,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

宏观方面,2022年上半年,国内疫情冲击、“俄乌”战争以及中美经济周期错位是影响国内外大类资产价格的主要因素。

国内方面,上半年经济总体偏弱,疫情对供应链扰动影响工业生产;服务业由于消费场景受限复苏乏力;地缘政治冲突导致原材料价格大幅上行,对生产成本带来显著压力;3月国内经济受疫情和“俄乌”战争冲击影响显著下滑,在此背景下,促销费、汽车购置税减征、加大对企业信贷支持和基础设施建设投资基金等“稳增长”政策不断出

台。4月以来，随着物流修复、疫情受影响地区逐步复工复产，“稳增长”政策逐步见效，5月和6月国内经济环比显著改善。

总体来看，上半年，财政前置，基建投资维持高位，地产投资仍然低迷，受汽车刺激政策影响，汽车销量显著改善，但整体消费仍然偏弱。利率总体区间震荡并维持相对低位，流动性相对宽松叠加需求偏弱，银行间流动性水平也维持较宽松水平。

海外方面，2022年上半年，海外经济总体处于逐步降温的趋势，但受“俄乌”战争冲突、供应链扰动和能源危机影响，海外通胀处于历史高位。6月美联储议息会议决定加息75BP，创1994年以来单次最大幅度的加息；美联储强控制通胀的决心，并下调2022年和2023年经济增长预期。就业是美国经济当前的亮点，但消费、投资和库存对GDP拉动均出现了放缓迹象，市场对美国经济衰退的担忧也逐步升温，美债利率从接近3.5%的高点逐步回落，最近美国十年期与两年期利率持续倒挂。未来，随着商品指数同比维持下行趋势，美国通胀预计也将逐步下行，但工资增速仍在高位，食品价格、房租和服务业价格仍有韧性，下行斜率预计较缓。

总体来看，中美经济周期错位是上半年宏观经济的重要特征，受美联储鹰派加息影响，十年期美债利率上半年显著上行，而国内利率在经济偏弱的背景下低位徘徊，中美经济周期错位也是二季度A股走出独立行情的重要因素。目前来看，国内“稳增长”政策推动经济从底部逐步企稳，美联储加息缩表背景下美国经济从高位逐步回落。上半年全球主要股指普遍下跌，美股跌幅较大，A股呈现V字形走势，跌幅相对较小。

基金操作层面，聚焦核心资产，根据产品设计对资产配置的要求，上半年，本基金继续执行了大、小盘个股相对均衡配置的核心-卫星策略。配置方向上，一季度重点布局受益涨价的大宗商品、新能源产业链、农产品以及“稳增长”链条，在一、二月取得了较好的表现；但国内疫情爆发后，四月市场快速下跌过程中，一季度表现较好的工业金属、生猪养殖板块出现深度回调，拖累组合净值回撤较大。5月以后，随着复工复产的提速，特别是汽车消费刺激政策的持续落地，本基金重点配置汽车产业链，重点聚焦整车、零部件、汽车电子、汽车智能化、上游原材料、中游电池等环节，净值出现明显回升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末天治核心成长混合（LOF）基金份额净值为0.6293元，本报告期内，基金份额净值增长率为-17.64%，同期业绩比较基准收益率为-7.04%，低于同期业绩比较基准收益率10.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观方面，国内在流动性相对宽松、“稳增长”政策稳步落地的背景下，经济预计将处于温和修复的趋势；但受地产信用风险扰动、消费场景受限、疫情导

致居民收入受到冲击的影响，预计本轮国内经济修复的强度将显著弱于2020年疫后的表现。下半年国内CPI预计维持上行趋势，但因需求偏弱、核心CPI低迷、输入性通胀压力较大，央行货币政策预计仍将保持相对宽松，并将兼顾长期和短期、经济增长和物价稳定、内部均衡和外部均衡。从外部因素来看，在通胀压力下，美国加息、缩表进程将导致经济逐步由降温向衰退周期转换，外需对我国经济拉动将逐步减弱，但我国制造业产业链和成本优势以及欧洲能源危机导致供给受限，直接或间接拉动了我国出口需求，预计下半年我国出口增速将处于缓慢下行趋势。随着美国经济回落、美债下行以及美联储从鹰派向鸽派转换，美联储加息对国内货币政策掣肘也将减少。

整体来看，我们认为，基于目前的宏观形势，下半年较难出现全面性上涨或下跌的走势，看好下半年A股结构性行情。下半年，本基金重点关注在全球能源转型和科技创新的背景下，具备科技成长属性的赛道，重点布局处于从“0到1”产业变革中的汽车智能化、从全球范围内看渗透率提升空间依然较大的新能源汽车产业链、全球能源转型中具备长期发展空间的光伏和风电、具备国产替代趋势的半导体设备、材料以及即将从实验室走向商业化的人形机器人等方向，挖掘具备长期价值的投资机会。

另外，本基金也将重点关注近两年经过持续调整的医药板块的投资机会，长期来看，医药赛道“长坡厚雪”的本质并未改变，随着医药“集采”所带来的存量优化，或将倒逼相关企业品质升级，从而推动医药行业整体的升级发展，行业成长依旧可期，下半年存在估值修复的潜力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人的基金估值和会计核算由基金结算部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制。基金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人和会计师事务所。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，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关

估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

本报告期，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收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	23,963,613.82	28,471,002.82
结算备付金		4,439,400.01	4,466,748.89
存出保证金		429,660.61	546,069.04
交易性金融资产	6.4.7.2	369,993,954.52	450,501,988.71
其中：股票投资		369,993,954.52	450,501,988.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		6,877,409.70	21,020,105.28
应收股利		-	-
应收申购款		154,579.49	11,378.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	8,012.89
资产总计		405,858,618.15	505,025,306.54
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,625,668.85	20,951,550.75
应付赎回款		571,134.90	76,825.75
应付管理人报酬		372,587.24	507,102.36
应付托管费		77,622.34	105,646.32
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,851,413.09	4,394,794.48
负债合计		12,498,426.42	26,035,919.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	320,319,343.09	321,240,367.77
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	73,040,848.64	157,749,019.11
净资产合计		393,360,191.73	478,989,386.88
负债和净资产总计		405,858,618.15	505,025,306.54

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额净值0.6293元，基金份额总额625,036,674.08份。

6.2 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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日至	上年度可比期间 2021年01月01日至202
-----	-----	--------------------	----------------------------

		2022年06月30日	1年06月30日
一、营业总收入		-81,736,091.87	-2,621,348.15
1. 利息收入		127,619.60	200,872.67
其中：存款利息收入	6.4.7.9	127,619.60	54,122.07
债券利息收入		-	146,750.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-109,184,459.21	9,018,889.00
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-111,441,008.74	5,666,776.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	277,902.71	286,018.39
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,978,646.82	3,066,094.32
以摊余成本计量的			
金融资产终止确认			
产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	27,310,671.93	-11,875,320.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,075.81	34,210.19
减：二、营业总支出		2,967,942.94	9,345,025.68

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,371,642.36	2,875,714.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	494,092.16	599,107.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	202.11
其中：卖出回购金融资产支出		-	202.11
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.56	0.09
8. 其他费用	6.4.7.18	102,207.86	5,870,001.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-84,704,034.81	-11,966,373.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-84,704,034.81	-11,966,373.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-84,704,034.81	-11,966,373.83

6.3 净资产（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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	321,240,367.77	-	157,749,019.11	478,989,386.88

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	321,240,367. 77	-	157,749,019. 11	478,989,386. 88
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-921,024.68	-	-84,708,170. 47	-85,629,195. 15
（一）、综合收益总额	-	-	-84,704,034. 81	-84,704,034. 81
（二）、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）	-921,024.68	-	-4,135.66	-925,160.34
其中：1. 基金申购款	11,379,286.8 9	-	2,969,307.85	14,348,594.7 4
2. 基金赎回款	-12,300,311. 57	-	-2,973,443.5 1	-15,273,755. 08
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	320,319,343. 09	-	73,040,848.6 4	393,360,191. 73
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	422,838,709.	-	157,574,219.	580,412,928.

（基金净值）	64		21	85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	422,838,709. 64	-	157,574,219. 21	580,412,928. 85
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	-52,667,194. 14	-	-31,179,815. 52	-83,847,009. 66
（一）、综合收益总 额	-	-	-11,966,373. 83	-11,966,373. 83
（二）、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）	-52,667,194. 14	-	-19,213,441. 69	-71,880,635. 83
其中：1. 基金申购款	12,746,528.0 6	-	3,502,308.29	16,248,836.3 5
2. 基金赎回 款	-65,413,722. 20	-	-22,715,749. 98	-88,129,472. 18
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	370,171,515. 50	-	126,394,403. 69	496,565,919. 19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 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的各种股票、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%，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：富时中国A股自由流通全盘指数×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。

6.4.2 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（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基

金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年6月30日的财务状况以及2022年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 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和金融负债，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益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；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币28,471,002.82元，自应收利息转入的重分类金额为人民币5,757.09元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币28,476,759.91元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币4,466,748.89元，自应收利息转入的重分类金额为人民币2,010.10元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币4,468,758.99元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币546,069.04元，自应收利息转入的重分类金额为人民币245.70元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币546,314.74元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币8,012.89元，转出至银行存款的重分类金额为人民币5,757.09元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币2,010.10元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币245.70元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资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。对证券投资基金在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，

已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2022年06月30日	
活期存款	23,963,613.82	
等于：本金	23,959,471.62	
加：应计利息	4,142.20	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
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	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	23,963,613.82	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	339,764,813.64	-	369,993,954.52	30,229,140.88
贵金属投资-金	-	-	-	-

交易所黄金合约					
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		339,764,813.64	-	369,993,954.52	30,229,140.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,028.90
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	3,700,144.79
其中：交易所市场	3,700,144.79
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	22,315.49
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	67,416.54
合计	3,851,413.09

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	626,833,690.80	321,240,367.77
本期申购	22,204,239.54	11,379,286.89
本期赎回（以“-”号填列）	-24,001,256.26	-12,300,311.57
本期末	625,036,674.08	320,319,343.09

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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
本期期初	339,612,679.49	-181,863,660.38	157,749,019.11
本期利润	-112,014,706.74	27,310,671.93	-84,704,034.81
本期基金份额交易产生的变动数	-281,719.51	277,583.85	-4,135.66
其中：基金申购款	10,044,531.21	-7,075,223.36	2,969,307.85
基金赎回款	-10,326,250.72	7,352,807.21	-2,973,443.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	227,316,253.24	-154,275,404.60	73,040,848.64

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	83,074.27
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	40,078.74
其他	4,466.59
合计	127,619.60

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	3,016,267,754.79
减：卖出股票成本总额	3,118,588,824.97
减：交易费用	9,119,938.56
买卖股票差价收入	-111,441,008.74

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	157.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	277,745.19
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	277,902.71

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,384,908.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,107,000.00
减：应计利息总额	162.24
减：交易费用	1.37
买卖债券差价收入	277,745.19

6.4.7.11.3 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。

6.4.7.11.4 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。

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益**6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,978,646.82
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,978,646.82

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	27,310,671.93
——股票投资	27,310,671.93
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允	-

价值变动产生的预估增值税	
合计	27,310,671.93

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	10,075.81
合计	10,075.81

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,385.00
账户维护费	18,000.00
合计	102,207.86

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天治基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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

注：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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.6 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。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至202 2年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,371,642.36	2,875,714.68

其中：支付销售机构的客户维护费	462,569.06	594,066.14
-----------------	------------	------------

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	494,092.16	599,107.21

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30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	23,963,613.82	83,074.27	23,682,390.71	30,037.45

注：本基金的银行存款由基金托管人银行保管，按银行同业利率计息。另外，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2022年6月30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（2021年6月30日：同）。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
688120	华海清科	2022-05-	1-6个月（含）	新股限售	136.66	217.12	1,386	189,410.	300,928.	注

		30						76	32	
688400	凌云光	2022-06-27	1个月内（含）	认购新发证券	21.93	21.93	6,962	152,676.66	152,676.66	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	1个月内（含）	认购新发证券	33.65	33.65	4,310	145,031.50	145,031.50	-
688290	景业智能	2022-04-21	1-6个月（含）	新股限售	33.89	46.87	3,040	103,025.60	142,484.80	注
688173	希荻微	2022-01-13	1-6个月（含）	新股限售	33.57	31.62	4,170	139,986.90	131,855.40	注
688237	超卓航科	2022-06-24	1个月内（含）	认购新发证券	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688163	赛伦生物	2022-03-02	1-6个月（含）	新股限售	33.03	23.56	3,607	119,139.21	84,980.92	注
301233	盛帮股份	2022-06-24	1个月内（含）	认购新发证券	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	1-6个月（含）	新股限售	19.18	32.07	1,036	19,870.48	33,224.52	注
301215	中汽股份	2022-02-28	1-6个月（含）	新股限售	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	注
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	1-6个月（含）	新股限售	17.27	14.83	1,508	26,043.16	22,363.64	注
301263	泰恩康	2022-03-	1-6个月（含）	新股限售	19.93	31.38	682	13,592.2	21,401.1	注

		22						6	6	
301201	诚达药业	2022-01-12	1-6个月（含）	新股限售	72.69	71.54	298	21,661.62	21,318.92	注
301122	采纳股份	2022-01-19	1-6个月（含）	新股限售	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	注
301302	华如科技	2022-06-16	1-6个月（含）	新股限售	52.03	56.42	339	17,638.17	19,126.38	注
301256	华融化学	2022-03-14	1-6个月（含）	新股限售	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	注
301162	国能日新	2022-04-19	1-6个月（含）	新股限售	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	注
301112	信邦智能	2022-06-20	1-6个月（含）	新股限售	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	注
301236	软通动力	2022-03-08	1-6个月（含）	新股限售	48.59	31.38	561	27,257.12	17,604.18	注
301153	中科江南	2022-05-10	1-6个月（含）	新股限售	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	注
301239	普瑞眼科	2022-06-22	1-6个月（含）	新股限售	33.65	33.65	479	16,118.35	16,118.35	注
301120	新特电气	2022-04-11	1-6个月（含）	新股限售	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	注
301109	军信股份	2022-04-	1-6个月（含）	新股限售	23.21	16.14	984	22,835.3	15,881.7	注

		06						6	6	
301235	华康医疗	2022-01-21	1-6个月（含）	新股限售	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	注
301200	大族数控	2022-02-18	1-6个月（含）	新股限售	76.56	51.92	297	22,738.32	15,420.24	注
301206	三元生物	2022-01-26	6个月以上	新股限售	72.76	45.69	329	23,936.70	15,032.01	注
301103	何氏眼科	2022-03-14	1-6个月（含）	新股限售	32.66	32.02	462	15,087.50	14,793.24	注
301216	万凯新材	2022-03-21	1-6个月（含）	新股限售	35.68	29.84	476	16,983.68	14,203.84	注
301207	华兰疫苗	2022-02-10	1-6个月（含）	新股限售	56.88	56.42	251	14,276.88	14,161.42	注
301248	杰创智能	2022-04-13	1-6个月（含）	新股限售	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	注
301102	兆讯传媒	2022-03-15	1-6个月（含）	新股限售	39.88	31.09	440	17,547.20	13,679.60	注
301258	富士莱	2022-03-21	1-6个月（含）	新股限售	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	注
301151	冠龙节能	2022-03-30	1-6个月（含）	新股限售	30.82	21.46	562	17,320.84	12,060.52	注
301219	腾远钴业	2022-03-	1-6个月（含）	新股限售	96.51	87.82	137	13,222.4	12,031.3	注

		10						8	4	
301097	天益医疗	2022-03-25	1-6个月（含）	新股限售	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	注
301116	益客食品	2022-01-10	1-6个月（含）	新股限售	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	注
301123	奕东电子	2022-01-14	1-6个月（含）	新股限售	37.23	25.39	455	16,939.65	11,552.45	注
301237	和顺科技	2022-03-16	1-6个月（含）	新股限售	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	注
301137	哈焊华通	2022-03-14	1-6个月（含）	新股限售	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	注
301222	浙江恒威	2022-03-02	1-6个月（含）	新股限售	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	注
300834	星辉环材	2022-01-06	1-6个月（含）	新股限售	55.57	30.03	318	17,671.26	9,549.54	注
301288	清研环境	2022-04-14	1-6个月（含）	新股限售	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	注
301163	宏德股份	2022-04-11	1-6个月（含）	新股限售	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	注
301130	西点药业	2022-02-16	1-6个月（含）	新股限售	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	注
301135	瑞德智能	2022-04-	1-6个月（含）	新股限售	31.98	26.26	338	10,809.2	8,875.88	注

		01						4		
3011 10	青木 股份	2022 -03- 04	1-6个月 (含)	新股 限售	63.1 0	39.8 5	202	12,7 46.2 0	8,04 9.70	注
3011 81	标榜 股份	2022 -02- 11	1-6个月 (含)	新股 限售	40.2 5	30.5 9	257	10,3 44.2 5	7,86 1.63	注
3011 58	德石 股份	2022 -01- 07	1-6个月 (含)	新股 限售	15.6 4	20.3 8	379	5,92 7.56	7,72 4.02	注
3012 28	实朴 检测	2022 -01- 21	6个月以 上	新股 限售	20.0 8	20.3 4	373	7,48 9.84	7,58 6.82	注
3011 96	唯科 科技	2022 -01- 04	1-6个月 (含)	新股 限售	64.0 8	37.5 2	184	11,7 90.7 2	6,90 3.68	注
3012 33	盛帮 股份	2022 -06- 24	1-6个月 (含)	新股 限售	41.5 2	41.5 2	158	6,56 0.16	6,56 0.16	注

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 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6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	23,963,613.82	-	-	-	-	-	23,963,613.82
结算备付金	4,439,400.01	-	-	-	-	-	4,439,400.01
存出保证金	429,660.61	-	-	-	-	-	429,660.61
交易性金融资产	-	-	-	-	-	369,993,954.52	369,993,954.52
应收清算款	-	-	-	-	-	6,877,409.70	6,877,409.70
应收申购款	-	-	-	-	-	154,579.49	154,579.49
资产总计	28,832,674.44	-	-	-	-	377,025,943.71	405,858,618.15
负债							
应付清算	-	-	-	-	-	7,625,668.85	7,625,668.85

天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）2022 年中期报告

算款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	571,134.90	571,134.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	372,587.24	372,587.24
应付托管费	-	-	-	-	-	77,622.34	77,622.34
其他负债	-	-	-	-	-	3,851,413.09	3,851,413.09
负债总计	-	-	-	-	-	12,498,426.42	12,498,426.42
利率敏感度缺口	28,832,674.44	-	-	-	-	364,527,517.29	393,360,191.73
上年度末 2021 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	28,471,002.82	-	-	-	-	-	28,471,002.82
结算备付金	4,466,748.89	-	-	-	-	-	4,466,748.89
存出保证金	546,069.04	-	-	-	-	-	546,069.04
交易性金融资产	-	-	-	-	-	450,501,988.71	450,501,988.71
应收证券清算款	-	-	-	-	-	21,020,105.28	21,020,105.28
应收利息	-	-	-	-	-	8,012.89	8,012.89
应收申购款	-	-	-	-	-	11,378.91	11,378.91
资产总计	33,483,820.75	-	-	-	-	471,541,485.79	505,025,306.54
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	20,951,550.75	20,951,550.75
应付赎回款	-	-	-	-	-	76,825.75	76,825.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	507,102.36	507,102.36
应付托管费	-	-	-	-	-	105,646.32	105,646.32
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,157,375.95	4,157,375.95
其他负	-	-	-	-	-	237,418.53	237,418.53

债							
负债总计	-	-	-	-	-	26,035,919.66	26,035,919.66
利率敏感度缺口	33,483,820.75	-	-	-	-	445,505,566.13	478,989,386.88

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	利率上升25个基点	-	-
	利率下降25个基点	-	-

本基金本期末和上年度末均未持有债券投资，故无利率风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	369,993,954.52	94.06	450,501,988.71	94.05
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	369,993,954.52	94.06	450,501,988.71	94.05

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	25,103,363.63	41,507,270.92
	业绩比较基准变动-5%	-25,103,363.63	-41,507,270.92

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	368,241,522.87	447,167,304.57
第二层次	498,573.60	615,688.35
第三层次	1,253,858.05	2,718,995.79
合计	369,993,954.52	450,501,988.71

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会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将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	369,993,954.52	91.16
	其中：股票	369,993,954.52	91.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	28,403,013.83	7.00
8	其他各项资产	7,461,649.80	1.84
9	合计	405,858,618.15	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	12,847,121.00	3.27
C	制造业	342,839,484.86	87.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,698,478.00	2.21
F	批发和零售业	34,585.80	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,315,031.08	1.35

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	13,679.60	0.00
M	科学研究和技术服务业	53,749.33	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	15,881.76	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	175,943.09	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	369,993,954.52	94.06

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601238	广汽集团	1,919,900	29,259,276.00	7.44
2	000625	长安汽车	1,676,870	29,043,388.40	7.38
3	300750	宁德时代	43,700	23,335,800.00	5.93
4	603799	华友钴业	226,070	21,616,813.40	5.50
5	300390	天华超净	217,700	19,026,980.00	4.84
6	600660	福耀玻璃	399,900	16,719,819.00	4.25
7	600741	华域汽车	709,900	16,327,700.00	4.15
8	688005	容百科技	117,400	15,196,256.00	3.86
9	002709	天赐材料	237,700	14,751,662.00	3.75
10	000762	西藏矿业	229,700	12,847,121.00	3.27
11	601689	拓普集团	177,700	12,160,011.00	3.09

12	002101	广东鸿图	509,700	11,621,160.00	2.95
13	300124	汇川技术	142,000	9,353,540.00	2.38
14	002466	天齐锂业	71,200	8,885,760.00	2.26
15	300712	永福股份	151,700	8,698,478.00	2.21
16	002459	晶澳科技	108,980	8,598,522.00	2.19
17	600499	科达制造	399,700	8,249,808.00	2.10
18	601012	隆基绿能	119,980	7,994,267.40	2.03
19	000887	中鼎股份	415,700	7,582,368.00	1.93
20	688167	炬光科技	50,700	7,541,625.00	1.92
21	002920	德赛西威	50,900	7,533,200.00	1.92
22	688518	联赢激光	217,700	7,399,623.00	1.88
23	002126	银轮股份	635,400	7,275,330.00	1.85
24	300274	阳光电源	69,300	6,808,725.00	1.73
25	002036	联创电子	423,700	6,508,032.00	1.65
26	300627	华测导航	186,600	6,417,174.00	1.63
27	688599	天合光能	87,700	5,722,425.00	1.45
28	603197	保隆科技	105,600	5,194,464.00	1.32
29	300496	中科创达	39,000	5,088,720.00	1.29
30	688388	嘉元科技	50,000	4,243,500.00	1.08
31	002906	华阳集团	87,700	3,973,687.00	1.01
32	603786	科博达	57,700	3,552,589.00	0.90
33	688326	经纬恒润	18,687	2,748,110.22	0.70
34	603179	新泉股份	87,700	2,543,300.00	0.65
35	603297	永新光学	19,800	2,211,858.00	0.56
36	601799	星宇股份	12,500	2,137,500.00	0.54
37	688120	华海清科	1,386	300,928.32	0.08
38	301239	普瑞眼科	4,789	161,149.85	0.04
39	688400	凌云光	6,962	152,676.66	0.04
40	688290	景业智能	3,040	142,484.80	0.04
41	688173	希荻微	4,170	131,855.40	0.03
42	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.03

43	688163	赛伦生物	3,607	84,980.92	0.02
44	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
45	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
46	301238	瑞泰新材	1,036	33,224.52	0.01
47	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.01
48	301217	铜冠铜箔	1,508	22,363.64	0.01
49	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.01
50	301201	诚达药业	298	21,318.92	0.01
51	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.01
52	301302	华如科技	339	19,126.38	0.00
53	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
54	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
55	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
56	301236	软通动力	561	17,604.18	0.00
57	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
58	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
59	301109	军信股份	984	15,881.76	0.00
60	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
61	301200	大族数控	297	15,420.24	0.00
62	301206	三元生物	329	15,032.01	0.00
63	301103	何氏眼科	462	14,793.24	0.00
64	301216	万凯新材	476	14,203.84	0.00
65	301207	华兰疫苗	251	14,161.42	0.00
66	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
67	301102	兆讯传媒	440	13,679.60	0.00
68	301166	优宁维	224	13,184.64	0.00
69	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
70	301151	冠龙节能	562	12,060.52	0.00
71	301219	腾远钴业	137	12,031.34	0.00
72	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
73	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00

74	301189	奥尼电子	348	11,591.88	0.00
75	301123	奕东电子	455	11,552.45	0.00
76	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
77	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
78	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
79	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
80	300834	星辉环材	318	9,549.54	0.00
81	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
82	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
83	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
84	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
85	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
86	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
87	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
88	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
89	301196	唯科科技	184	6,903.68	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603363	傲农生物	81,600,910.15	17.04
2	000630	铜陵有色	73,363,383.64	15.32
3	601600	中国铝业	71,041,938.67	14.83
4	603993	洛阳钼业	70,860,077.14	14.79
5	002460	赣锋锂业	70,352,008.00	14.69
6	300498	温氏股份	68,476,015.13	14.30
7	002714	牧原股份	67,187,309.50	14.03
8	600111	北方稀土	66,840,919.06	13.95
9	002466	天齐锂业	63,577,962.34	13.27

10	300750	宁德时代	62,516,711.21	13.05
11	603799	华友钴业	51,848,723.90	10.82
12	600547	山东黄金	51,251,419.76	10.70
13	601899	紫金矿业	50,248,087.79	10.49
14	600497	驰宏锌锗	47,086,151.62	9.83
15	002100	天康生物	45,165,635.31	9.43
16	002271	东方雨虹	41,770,133.95	8.72
17	600690	海尔智家	41,208,921.58	8.60
18	601111	中国国航	39,321,227.80	8.21
19	002241	歌尔股份	38,436,379.96	8.02
20	002567	唐人神	36,119,459.64	7.54
21	000876	新希望	32,540,428.00	6.79
22	601238	广汽集团	30,600,037.00	6.39
23	000933	神火股份	29,347,244.28	6.13
24	688005	容百科技	28,765,100.44	6.01
25	002240	盛新锂能	28,507,239.00	5.95
26	300274	阳光电源	28,449,989.00	5.94
27	603833	欧派家居	27,924,921.00	5.83
28	601012	隆基绿能	26,944,843.40	5.63
29	603501	韦尔股份	25,029,898.30	5.23
30	601658	邮储银行	24,693,261.11	5.16
31	601166	兴业银行	24,513,803.00	5.12
32	300390	天华超净	24,257,717.00	5.06
33	601888	中国中免	23,847,362.00	4.98
34	002475	立讯精密	23,845,876.71	4.98
35	000807	云铝股份	23,626,122.00	4.93
36	601009	南京银行	22,416,724.09	4.68
37	000625	长安汽车	21,685,339.57	4.53
38	600988	赤峰黄金	20,452,358.00	4.27
39	300122	智飞生物	19,971,165.04	4.17
40	300450	先导智能	19,817,088.78	4.14

41	002709	天赐材料	19,658,614.20	4.10
42	600660	福耀玻璃	19,273,130.72	4.02
43	002142	宁波银行	19,082,397.54	3.98
44	600309	万华化学	19,026,565.00	3.97
45	002352	顺丰控股	18,855,372.00	3.94
46	002268	卫士通	18,812,970.48	3.93
47	000960	锡业股份	18,156,987.67	3.79
48	002812	恩捷股份	17,717,379.32	3.70
49	600745	闻泰科技	17,713,009.80	3.70
50	000762	西藏矿业	17,615,712.00	3.68
51	000887	中鼎股份	17,268,046.28	3.61
52	600926	杭州银行	17,231,176.17	3.60
53	300035	中科电气	16,697,113.00	3.49
54	600328	中盐化工	16,410,266.00	3.43
55	600741	华域汽车	16,190,985.00	3.38
56	688518	联赢激光	16,118,739.62	3.37
57	601838	成都银行	16,100,664.85	3.36
58	688599	天合光能	16,025,062.25	3.35
59	600519	贵州茅台	15,689,036.00	3.28
60	002036	联创电子	14,274,000.00	2.98
61	300497	富祥药业	14,213,730.28	2.97
62	600011	华能国际	14,128,178.00	2.95
63	000656	金科股份	14,027,307.00	2.93
64	601689	拓普集团	13,695,124.00	2.86
65	600919	江苏银行	13,558,910.80	2.83
66	002791	坚朗五金	13,480,219.10	2.81
67	600499	科达制造	13,443,772.00	2.81
68	000707	双环科技	13,161,253.74	2.75
69	601677	明泰铝业	13,005,077.00	2.72
70	000301	东方盛虹	12,958,531.99	2.71
71	600975	新五丰	12,661,103.00	2.64

72	600048	保利发展	12,406,101.51	2.59
73	601919	中远海控	12,389,965.60	2.59
74	300316	晶盛机电	12,367,729.00	2.58
75	603098	森特股份	12,346,076.00	2.58
76	300737	科顺股份	12,149,195.60	2.54
77	002459	晶澳科技	12,114,932.00	2.53
78	001979	招商蛇口	12,109,841.00	2.53
79	000568	泸州老窖	11,973,294.02	2.50
80	600720	祁连山	11,936,203.00	2.49
81	688388	嘉元科技	11,925,345.75	2.49
82	600809	山西汾酒	11,909,889.00	2.49
83	002101	广东鸿图	11,839,598.08	2.47
84	688499	利元亨	11,831,527.19	2.47
85	601225	陕西煤业	11,692,736.96	2.44
86	002192	融捷股份	11,684,447.00	2.44
87	002043	兔宝宝	11,579,464.00	2.42
88	000333	美的集团	11,193,063.62	2.34
89	603369	今世缘	11,178,607.00	2.33
90	603520	司太立	11,111,945.04	2.32
91	002821	凯莱英	10,781,905.00	2.25
92	600406	国电南瑞	10,744,252.42	2.24
93	002304	洋河股份	10,721,900.00	2.24
94	300015	爱尔眼科	10,514,912.41	2.20
95	688111	金山办公	10,424,261.07	2.18
96	603538	美诺华	10,383,334.28	2.17
97	603477	巨星农牧	10,275,517.00	2.15
98	002507	涪陵榨菜	9,913,503.00	2.07
99	300124	汇川技术	9,733,159.50	2.03
100	688187	时代电气	9,701,306.29	2.03
101	300223	北京君正	9,636,068.00	2.01
102	000001	平安银行	9,616,240.72	2.01

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002460	赣锋锂业	102,100,891.22	21.32
2	002466	天齐锂业	85,987,760.71	17.95
3	000630	铜陵有色	77,626,025.23	16.21
4	603363	傲农生物	73,048,476.69	15.25
5	603993	洛阳钼业	68,920,146.00	14.39
6	601600	中国铝业	68,223,072.00	14.24
7	600111	北方稀土	67,413,285.42	14.07
8	601899	紫金矿业	67,006,952.68	13.99
9	002714	牧原股份	65,159,787.06	13.60
10	300498	温氏股份	64,187,460.13	13.40
11	002241	歌尔股份	53,719,103.32	11.22
12	600547	山东黄金	49,999,948.37	10.44
13	600497	驰宏锌锗	46,708,562.79	9.75
14	300750	宁德时代	46,581,853.14	9.73
15	002100	天康生物	44,317,809.01	9.25
16	603799	华友钴业	43,716,006.56	9.13
17	300390	天华超净	43,365,471.60	9.05
18	601012	隆基绿能	42,762,213.26	8.93
19	600690	海尔智家	41,293,105.32	8.62
20	002271	东方雨虹	39,803,804.29	8.31
21	002268	卫士通	37,245,835.19	7.78
22	601111	中国国航	37,041,171.27	7.73
23	002567	唐人神	32,910,116.23	6.87
24	000876	新希望	32,557,087.67	6.80

25	000933	神火股份	30,335,969.20	6.33
26	300274	阳光电源	29,907,952.02	6.24
27	002240	盛新锂能	27,996,440.37	5.84
28	603833	欧派家居	26,857,237.66	5.61
29	600418	江淮汽车	24,652,176.24	5.15
30	603501	韦尔股份	24,549,822.00	5.13
31	002475	立讯精密	23,641,673.92	4.94
32	601888	中国中免	22,961,402.60	4.79
33	601658	邮储银行	22,869,007.00	4.77
34	000887	中鼎股份	22,649,311.50	4.73
35	300450	先导智能	22,648,617.00	4.73
36	000807	云铝股份	22,563,132.39	4.71
37	601166	兴业银行	21,808,229.00	4.55
38	601009	南京银行	21,135,806.45	4.41
39	600988	赤峰黄金	20,592,942.91	4.30
40	300122	智飞生物	19,822,592.00	4.14
41	002236	大华股份	19,818,120.00	4.14
42	300059	东方财富	19,471,542.40	4.07
43	600011	华能国际	19,170,397.00	4.00
44	300316	晶盛机电	19,091,466.50	3.99
45	600309	万华化学	19,018,060.00	3.97
46	002352	顺丰控股	18,444,204.00	3.85
47	002812	恩捷股份	18,123,990.01	3.78
48	600406	国电南瑞	18,045,531.00	3.77
49	002142	宁波银行	17,530,340.70	3.66
50	000960	锡业股份	17,273,300.70	3.61
51	300035	中科电气	17,054,304.27	3.56
52	600926	杭州银行	16,813,307.49	3.51
53	600328	中盐化工	16,577,048.00	3.46
54	600745	闻泰科技	16,498,696.00	3.44
55	688599	天合光能	16,142,213.77	3.37

56	600522	中天科技	16,115,752.00	3.36
57	000707	双环科技	15,660,409.00	3.27
58	600519	贵州茅台	15,417,986.00	3.22
59	600499	科达制造	14,952,686.00	3.12
60	601838	成都银行	14,522,585.00	3.03
61	688005	容百科技	14,412,297.21	3.01
62	688499	利元亨	13,744,781.95	2.87
63	002791	坚朗五金	13,442,331.00	2.81
64	000301	东方盛虹	13,088,439.00	2.73
65	601225	陕西煤业	12,858,267.00	2.68
66	300497	富祥药业	12,455,374.40	2.60
67	002192	融捷股份	12,304,930.00	2.57
68	600919	江苏银行	12,227,039.10	2.55
69	002459	晶澳科技	12,013,087.48	2.51
70	300737	科顺股份	11,979,361.82	2.50
71	601677	明泰铝业	11,945,027.00	2.49
72	000656	金科股份	11,814,566.00	2.47
73	600720	祁连山	11,653,148.80	2.43
74	002756	永兴材料	11,602,621.00	2.42
75	002043	兔宝宝	11,576,774.00	2.42
76	603098	森特股份	11,312,274.60	2.36
77	300015	爱尔眼科	11,259,241.10	2.35
78	601919	中远海控	11,228,626.50	2.34
79	000568	泸州老窖	11,165,787.00	2.33
80	600809	山西汾酒	10,937,539.00	2.28
81	000002	万科A	10,747,968.00	2.24
82	603568	伟明环保	10,720,559.60	2.24
83	000333	美的集团	10,690,803.00	2.23
84	000858	五粮液	10,646,565.98	2.22
85	600048	保利发展	10,624,024.00	2.22
86	603369	今世缘	10,511,664.00	2.19

87	603520	司太立	10,411,391.00	2.17
88	001979	招商蛇口	10,406,194.00	2.17
89	002304	洋河股份	10,378,953.96	2.17
90	601868	中国能建	10,330,361.00	2.16
91	603477	巨星农牧	10,289,935.00	2.15
92	002507	涪陵榨菜	10,183,527.43	2.13
93	300223	北京君正	10,096,227.00	2.11
94	600975	新五丰	10,034,637.60	2.09
95	002821	凯莱英	9,761,107.00	2.04
96	688111	金山办公	9,706,826.63	2.03
97	603259	药明康德	9,599,279.00	2.00
98	601669	中国电建	9,592,151.00	2.00

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,010,770,118.85
卖出股票收入（成交）总额	3,016,267,754.79

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，容百科技的发行主体在报告编制日前一年内曾受到余姚市应急管理局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	429,660.61
2	应收清算款	6,877,409.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	154,579.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	7,461,649.80

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
36,122	17,303.49	1,220,830.96	0.20%	623,815,843.12	99.80%

8.2 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	陈瑞荣	2,051,600.00	0.33%
2	陈明杰	1,986,885.00	0.32%
3	顾伟	606,100.00	0.10%
4	黄莓	520,721.00	0.08%
5	陈红梅	519,879.00	0.08%
6	曹建敏	519,401.00	0.08%
7	杨胜利	480,000.00	0.08%
8	罗雪娟	412,900.00	0.07%

9	聂玉洁	405,000.00	0.06%
10	黄国建	360,715.00	0.06%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	12,073.03	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年01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	626,833,690.80
本报告期基金总申购份额	22,204,239.54
减：本报告期基金总赎回份额	24,001,256.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	625,036,674.08

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
德邦证券	1	483,277,905.03	8.04%	450,076.73	8.11%	-
东北证券	1	892,622,765.37	14.85%	817,205.79	14.72%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	477,427,878.38	7.94%	444,626.10	8.01%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联	1	275,763,446.36	4.59%	256,817.79	4.63%	-

证券						
国融证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	206,188,571.24	3.43%	189,557.38	3.41%	-
国泰君安	1	155,151,000.30	2.58%	144,493.14	2.60%	-
国信证券	1	12,421,052.70	0.21%	11,443.47	0.21%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	463,177,849.11	7.70%	431,357.27	7.77%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	467,877,118.19	7.78%	435,741.88	7.85%	-
长江证券	2	621,712,287.30	10.34%	568,731.25	10.25%	-
川财证券	2	249,285,971.91	4.15%	228,807.70	4.12%	-

方正证券	2	344,220,845.91	5.73%	315,318.04	5.68%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	676,115,936.92	11.25%	616,859.46	11.11%	-
粤开证券	1	520,660,488.55	8.66%	484,890.10	8.74%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	166,543,282.81	2.77%	155,099.85	2.79%	-

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：新增爱建证券上海交易单元1个、

方正证券深圳交易单元1个、开源证券深圳交易单元1个、广发证券北京交易单元1个，退租安信证券上海交易单元1个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
德邦证券	468,872.00	33.86%	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	916,036.80	66.14%	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 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关于公司旗下基金产品执行新金融工具会计准则的公告	中国证监会指定媒介	2022-01-05
2	天治基金管理有限公司旗下基金2021年第4季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-01-21
3	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)2021年第4度报告	中国证监会指定媒介	2022-01-21
4	天治基金管理有限公司旗下基金2021年年度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-03-25
5	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)2021年年度报告	中国证监会指定媒介	2022-03-25
6	天治基金管理有限公司旗下基金增加中植基金为代销机构、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	中国证监会指定媒介	2022-03-25
7	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加广发证券基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2022-03-30
8	天治基金管理有限公司关于调整旗下部分基金所持新五丰股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2022-04-19
9	天治基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2022-04-19

	调整旗下部分基金所持“新五丰”股票估值方法的公告		
10	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)2022年第1季报公告	中国证监会指定媒介	2022-04-21
11	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)2022年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2022-04-21
12	天治基金管理有限公司旗下基金2022年第1季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-04-21
13	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加西部证券定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2022-04-25
14	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加西部证券基金申购手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2022-06-14
15	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2022-06-17
16	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同	中国证监会指定媒介	2022-06-17
17	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书	中国证监会指定媒介	2022-06-17
18	天治基金管理有限公司关于天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)变更业绩比较基准并修改基金合同的公告	中国证监会指定媒介	2022-06-17
19	天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加申万宏源证	中国证监会指定媒介	2022-06-20

	券、申万宏源西部证券费率优惠活动的公告		
20	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加腾安基金为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2022-06-28
21	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加诺亚正行为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2022-06-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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：本基金本报告期末未存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）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）托管协议》
4. 《天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
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

12.2 存放地点

天治基金管理有限公司办公地点-上海市复兴西路159号。

12.3 查阅方式

1. 书面查询：查阅时间为每工作日8:30-11:30, 13:00-17:00。投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

2. 网站查询：www.chinanature.com.cn

天治基金管理有限公司
二〇二二年八月三十日