

# 天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:天风(上海)证券资产管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、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。本中期报告已由董事长签发。

集合计划托管人中信银行股份有限公司根据本资产管理计划合同规定，于2024年8月28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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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集合计划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2024年1月1日起至2024年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 .....	9
2.4 信息披露方式 .....	10
2.5 其他相关资料 .....	10
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	10
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现 .....	11
§4 管理人报告 .....	12
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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 .....	15
§5 托管人报告 .....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
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 .....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表 .....	17
6.3 净资产变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	20
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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 .....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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 .....	51
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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55

8.3 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情况.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划
基金简称	天风天盈一年定开混合
基金主代码	970023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年08月30日
基金管理人	天风（上海）证券资产管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	74,845,112.98份
基金合同存续期	三年

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划依託管理人的投资研究优势，在深入分析、精选投资标的的基础上，主要投资于具备良好价值、持续增长能力的优秀企业，通过科学合理的资产配置，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划在资产配置方面主要通过自上而下地研究宏观经济运行趋势、深入分析财政及货币政策对经济运行的影响，判断市场走势、利率变化、资产波动性等因素，决定大类资产在品种、级别、期限等维度的分布配置，力争实现投资组合稳健增值、同时降低投资组合波动。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>本集合计划将在考虑行业生命周期、宏观经济周期不同阶段的行业景气程度以及股票市场行业轮动规律的基础上，结合当前经济发展和资本市场特征，从历史估值比较和未来成长趋势等方面进行深入分析，重点关注符合经济发展趋势、产业升级转型方向，具有巨</p>

大成长空间的行业。在优选行业的基础上，再根据重点关注行业的景气度变化及时对行业配置进行动态调整。

#### （2）股票精选策略

本集合计划结合使用定量分析和定性分析精选标的股票，通过对企业、行业的发展脉络进行全方位的分析与综合权衡，选出中长期具备持续增长能力且短期边际向好的优质企业作为投资对象。在深入研究基本面的基础上，坚持价值投资理念，力争准确把握投资机会，不为短期波动影响。

#### （3）港股通标的股票投资策略

本集合计划在分析宏观经济形势和行业发展基础上，精选港股市场中的优质上市企业，有针对性地根据不同指标选取具有成长性和投资价值的上市公司构建股票池。在具体操作上，将基于宏观背景主要采用个股精选策略，综合运用定量分析与定性分析的手段，对公司进行价值挖掘。

#### （4）量化增强策略

本集合计划采用量化增强模型进行资产定价和风险控制。通过量化增强模型形成对上市公司的收益预测，通过风险模型对投资组合进行风险预测，最后在各项预测的基础上进行投资组合优化，最终确定股票投资组合中的持仓。其中量化增强模型主要包括以下二个部分：

动态多因子模型：由基本面、技术面、情绪面三大类因子组成的多因子模型，根据市场长中短期表现动态调整三类因子的权重，最后形成投资组合，主要捕捉了市场风格轮动、板块轮动方向。

事件驱动模型：由正面事件、负面事件构造的新闻舆情模型，捕捉了特殊事件对个股的额外影响。

量化增强模型同时使用多个量化模型来捕捉市场中不同维度，不同来源、不同形式的投资机会，并通过动态调整各模型之间的权重配置使整个策略获得更好的收益、更小的回撤和更佳的收益风险比。

### 3、债券投资策略

#### （1）债券久期策略

通过对宏观经济周期所处阶段、政策可能演进轨迹进行分析，决定目标久期。如果预期利率下降，将增加久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，将缩短久期，以减小债券价格下降带来的风险。

#### （2）曲线相对价值策略

收益率曲线形状变化代表长、中、短期债券收益率相对变化，相同久期债券组合在收益率曲线形状发生较大变化时收益会产生差异。通过不同期限间债券利差的历史比较，在目标久期范围内，可以进一步选择子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略等，也可以结合国债期货进行斜率和凸度变化的交易。

#### （3）曲线骑乘策略

曲线骑乘策略即找寻收益率曲线斜率较陡区域，买入期限位于较陡处右侧的债券。在收益率曲线基本不变的情况下，随着时间推移，债券收益率将沿陡峭区域曲线下滑，从而有机会获得较好资本利得。

#### （4）杠杆息差策略

杠杆息差策略操作即当债券回购利率系统性低于债券利率时，利用质押式回购、买断式回购等方式融入低成本资金，并购买收益率相对较高的债券，以期获取净利息收入的操作方式。

#### （5）信用债投资策略

债券的信用利差主要受两个方面的影响，一是市场信用利差曲线的走势；二是债券本身的信用变化。本集合计划依靠对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等分析，判断市场信用利差曲线整体及分行业走势，确定各期限、各类属信用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资，减持信用利差被低估、未来信用利差可能上升的信用债券。

#### （6）可转换债券投资策略

本集合计划将在深入研究可转换债券价值影响历史规律的基础上，结合发行人的经营状况以及市场变化趋势，挖掘相应的投资机会。一方面可转换债券具有债券的价值保护，能够降低本集合计划净值的下行风险；另一方面，正股上涨会显著提升可转换债券的转股价值，为组合带来超额收益。择券时在精选标的正股的基础上，要根据隐含波动率/历史波动率、转股溢价率、纯债溢价率等指标判断可转换债券的估值水平，还要分析一些特殊条款对可转换债券价值的潜在影响，包括修正转股价条款、回售条款和赎回条款等。

#### 4、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本集合计划将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本集合计划将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### 5、国债期货投资策略

本集合计划在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### 6、股指期货投资策略

在股指期货投资上，本集合计划以套期保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本集合计划在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估

	<p>值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率，并利用股指期货流动性较好的特点对冲集合计划的流动性风险等。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本集合计划为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本集合计划有关投资限制与投资比例的前提下，将增加高流动性的投资品种的配置，满足开放期流动性需求。</p>
业绩比较基准	中证全指指数收益率×40% + 恒生指数收益率×10% + 中债综合财富指数收益率×50%
风险收益特征	本集合计划为混合型集合资产管理计划，其风险收益水平低于股票型基金及股票型集合资产管理计划，高于债券型基金及债券型集合资产管理计划、货币市场基金及货币型集合资产管理计划。

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### 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		天风（上海）证券资产管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱守中	庄世丹
	联系电话	13564639604	0755-25945808
	电子邮箱	qianshouzhong_zg@tfzq.com	zhuangshidan_sz@citicbank.com
客户服务电话		95391/400-800-5000	95558
传真		021-22062975	010-58810930
注册地址		上海市虹口区东大名路678号5楼	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		上海市虹口区东大名路678号5楼	深圳市福田区中心三路卓越时代广场二期中信证券大厦8楼
邮政编码		200080	518048

法定代表人	付玉	方合英
-------	----	-----

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.tfzqam.com
基金中期报告备置地点	上海市虹口区东大名路678号5楼

## 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	北京市西城区太平桥大街17号

## §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 (2024年01月01日-2024年06月30日)
	本期已实现收益
本期利润	-2,884,180.43
加权平均基金份额本期利润	-0.0385
本期加权平均净值利润率	-5.60%
本期基金份额净值增长率	-5.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
	期末可供分配利润
期末可供分配基金份额利润	-0.3220
期末基金资产净值	50,748,519.80
期末基金份额净值	0.6780

3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-32.20%

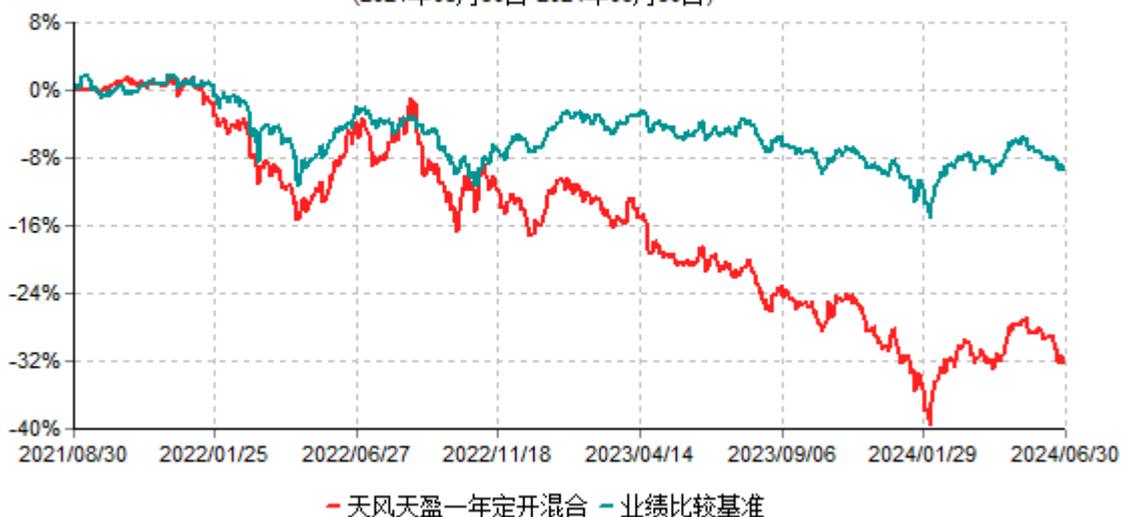
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.35%	0.71%	-2.10%	0.33%	-3.25%	0.38%
过去三个月	-0.95%	0.85%	-0.92%	0.46%	-0.03%	0.39%
过去六个月	-5.39%	1.11%	-1.05%	0.60%	-4.34%	0.51%
过去一年	-15.66%	0.96%	-4.56%	0.52%	-11.10%	0.44%
自基金合同生效起至今	-32.20%	0.87%	-9.30%	0.55%	-22.90%	0.32%

#### 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

天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年08月30日-2024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

天风（上海）证券资产管理有限公司（以下简称“天风资管”）是经中国证监会批准，依据相关法律法规要求，由天风证券股份有限公司（以下简称“天风证券”）出资人民币5亿元发起设立的证券资产管理公司。

2020年3月27日，天风证券收到中国证监会《关于核准天风证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可〔2020〕517号），获准设立全资资产管理子公司。2020年8月24日，经上海市虹口区市场监督管理局批准，天风资管取得工商营业执照注册成立，并于2020年12月取得经营证券期货业务许可，正式展业。2021年6月21日，天风资管增资5亿元，现注册资本10亿元。天风资管主要经营证券资产管理业务，包括单一资产管理业务、集合资产管理业务和专项资产管理业务。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求，截至2024年6月30日，天风资管共管理了3只参照公开募集证券投资基金运作的集合计划：天风六个月滚动持有债券型集合资产管理计划、天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划、天风金管家货币型集合资产管理计划。

#### 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		
贾玉淼	公募投资部总经理助理、投资经理	2023-04-20	-	20	清华大学硕士，历任嘉实基金研究员，国泰基金基金经理助理，北京广益国经投资管理有限公司投资经理，广益兄弟资产管理(北京)有限公司投资经理、银河资本资产管理有限公司投资经理，现任天风(上海)证券资产管理有限公司公募投资部总经理助理、投资经理。
邱天	公募投资部投	2023-08-10	-	7	毕业于南开大学，金融学硕

	资经理				士学历，7年证券行业从业经历。2016年6月加入天风证券股份有限公司，现任天风（上海）证券资产管理有限公司公募投资部投资经理职位。
--	-----	--	--	--	---

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本集合计划管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》、计划合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划资产，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损集合计划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

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本集合计划管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部相关公平交易制度等规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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5%的交易。

#### 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

2024年上半年，国内经济在结构调整深化进程中迎来新的挑战，虽然A股部分指数如上证指数、沪深300指数等表现并不算弱，但市场关于“价值与成长”、“大票与小票”以及“短期与长期”的定价仍处在一个相对割裂的状态。当下全社会各个部门主动承担风险的意愿都是很有限的，所以大量风险资产的定价正在偏向钟摆的另一端，对于权益投资者而言，企业价值究竟几何、中长期的竞争优势和成长空间是否还存在以及投资一家企业未来潜在的回报能否匹配现在要承受的风险，这些最基础也最重要的问题应该是现在更值得去思考和探究的。

本集合计划今年上半年未能取得较好表现，一方面是因为一季度组合保持偏高权益仓位运作导致未能有效回避市场大幅下跌带来的冲击，另外二季度组合虽然小幅降低了权益仓位，但因为整体配置依然偏向成长风格，所以在市场调整过程中还是受到了影响，另外可转债二季度表现较弱也对组合形成了一定拖累。

从权益投资的角度，我们依然对国内优质资产在低利率环境下实现系统性估值修复充满信心，但我们也要更多的从企业经营者的视角出发，去强化对于“好生意”的认知和理解；从组合管理的角度，我们需要更谨慎地思考和判断“安全边际”，不断挑战固有的思维和观点，尝试更多的方法和视角，在缺乏信心和增量资金的大背景下，更优的组合波动控制和回撤控制会越发重要。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末天风天盈一年定开混合集合计划份额净值为0.6780元，本报告期内，集合计划份额净值增长率为-5.39%，同期业绩比较基准收益率为-1.05%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面市场也许正在临近某个重要的拐点。无论是美联储即将开启降息周期，还是美国大选可能带来的变化和波动，以及国内全面深化改革的成效也大概率会在未来逐渐显现，这些变化都可能会改变各类资产当下的运行趋势。诚然，我们很难完全抛开所处位置的固有偏见，但当一次次深入走进各行各业想要探究些什么的时候，除了那些人尽皆知的困难，我们依然会看到缤纷的色彩和无限的可能，也会清晰的感受到企业家们迎难而上的勇气。这些公司这些企业家这些普普通通的劳动者，他们也都是宏观的一部分，透过他们，我们可以在前行迷雾中看到光亮。

权益市场当前对各种风险的定价十分敏感，却在相当程度上忽视了许多优质企业的内在价值和投资机会。我们要做的就是立足当下，既做好应对更糟糕局面的准备，但也要比以往更加坚定地去做好基本面研究，坚持每一天都要做出更优决策的目标，积极拥抱挑战 and 变化。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和资产管理计划合同关于估值的约定，对本集合计划所持有的投资品种进行估值。本集合计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本报告期内，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

本报告期内本集合计划未实施利润分配，符合相关法律法规及本集合计划合同中关于收益分配条款的规定。

#### 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，本集合计划未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满二百或者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

本托管人在托管本计划资产期间，严格遵守有关法律法规和计划合同、托管协议的规定，诚信地履行了托管人的职责，不存在损害本计划持有人利益的行为。

#### 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

本托管人依照有关法律法规和托管协议对本计划管理人的投资运作进行了必要的监督。本托管人认为，天风（上海）证券资产管理有限公司在本计划的运作中不存在损害计划份额持有人利益的行为；在报告期间，遵守了有关法律法规，在各重要方面的运作按照计划合同的规定执行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整没有异议。

### §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：天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	504,104.37	2,904,701.21
结算备付金		754,878.20	109,328.57
存出保证金		6,031.24	55,977.33

交易性金融资产	6.4.7.2	56,300,753.96	58,608,014.01
其中：股票投资		32,103,467.00	41,845,243.00
基金投资		-	-
债券投资		24,197,286.96	16,762,771.01
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	4,500,000.00	4,999,660.54
应收清算款		-	133,382.18
应收股利		28,253.82	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		62,094,021.59	66,811,063.84
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		11,010,388.16	11,003,230.20
应付清算款		213,479.77	1,967,539.75
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		51,669.16	66,549.82
应付托管费		3,444.60	3,619.68
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,302.45	356.89
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.4	56,217.65	137,067.27
负债合计		11,345,501.79	13,178,363.61
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.5	74,845,112.98	74,845,112.98
未分配利润	6.4.7.6	-24,096,593.18	-21,212,412.75
净资产合计		50,748,519.80	53,632,700.23
负债和净资产总计		62,094,021.59	66,811,063.84

## 6.2 利润表

会计主体：天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		-2,373,238.91	-4,329,205.37
1.利息收入		55,170.79	102,223.13
其中：存款利息收入	6.4.7.7	8,888.88	61,858.54
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		46,281.91	40,364.59
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		1,190,589.98	-4,167,824.66
其中：股票投资收益	6.4.7.8	307,199.41	-4,005,318.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.9	246,989.54	-832,903.78
资产支持证券投资 收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.10	636,401.03	670,398.00
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.11	-3,618,999.68	-263,603.84
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		510,941.52	1,253,619.50
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	306,881.82	909,285.46
2.托管费	6.4.10.2.2	20,458.76	48,495.19
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		119,127.08	198,045.50
其中：卖出回购金融资产支出		119,127.08	198,045.50
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		1,800.64	15,084.09
8.其他费用	6.4.7.12	62,673.22	82,709.26
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-2,884,180.43	-5,582,824.87
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-2,884,180.43	-5,582,824.87
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-2,884,180.43	-5,582,824.87

### 6.3 净资产变动表

会计主体：天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	74,845,112.98	-21,212,412.75	53,632,700.23
二、本期期初净资产	74,845,112.98	-21,212,412.75	53,632,700.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-2,884,180.43	-2,884,180.43
（一）、综合收益总额	-	-2,884,180.43	-2,884,180.43
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	74,845,112.98	-24,096,593.18	50,748,519.80
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	144,758,518.69	-22,801,473.12	121,957,045.57

产			
二、本期期初净资产	144,758,518.69	-22,801,473.12	121,957,045.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-5,582,824.87	-5,582,824.87
（一）、综合收益总额	-	-5,582,824.87	-5,582,824.87
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	144,758,518.69	-28,384,297.99	116,374,220.70

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：

付玉

付玉

朱霞

-----

-----

-----

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

天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由天风证券天盈1号集合资产管理计划变更而来。

天风证券天盈1号集合资产管理计划由天风证券股份有限公司发起设立，中信银行股份有限公司担任本集合计划托管人，天风证券天盈1号集合资产管理计划自2013年5月13日至2013年5月27日公开募集，经中勤万信会计师事务所有限公司对集合计划进行验资并出具勤信验字[2013]第36号验资报告后，于2013年5月30日成立并开始运作。根据中国证监会《关于核准天风证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2020]517号），天风（上海）证券资产管理有限公司已成立并于2020年12月10日取得经营证券业务许可证。天风证券天盈1号集合资产管理计划管理人由“天风证券股份有限公司”变更为“天风（上海）证券资产管理有限公司”。根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告（2018）39号），天风证券天盈1号集合资产管理计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将名称变更为“天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划”，变更后的《天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划资产管理合同》自2021年8月30日起生效，原《天风证券天盈1号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。本集合计划自本合同生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市或准予注册的股票)、港股通标的股票、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可转换债券、可分离交易债券、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货等以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于股票资产的比例为集合计划资产的20%-65%(其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%)。

#### 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(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《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<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本集合计划2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日止会计期间的经营成果和计划净值变动情况。

### 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

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列企业会计准则、《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。

#### 6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本会计期间为2024年1月1日至2024年6月30日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本集合计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本集合计划管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本集合计划现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### (2) 金融负债分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划目前暂无金融负债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。本集合计划持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票和债券，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

金融资产转移，是指本集合计划将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本集合计划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；本集合计划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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

(1)对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。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，管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)对不存在活跃市场的投资品种，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，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划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，同时本集合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。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于申购确认日及赎回确认日确认。

#### 6.4.4.8 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计划份额时，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）占计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占计划净值比例计算的金额。损益平准金于计划申购确认日或计划赎回确认日确认。

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）”。

#### 6.4.4.9 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)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。

(3)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；同时，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作为债券利息确认为债券投资收益，在债券实际持有期内逐日计提。

(4)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；同时，按证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资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额作为资产支持证券利息确认为资产支持证券投资收益，在证券实际持有期内逐日计提。

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

(6)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。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

针对本资产管理计划合同约定费率和计算方法的费用，本集合计划在费用涵盖期间按合同约定进行确认。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按直线法近似计算。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1)在符合有关集合计划分红条件的前提下，本管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时管理人公告为准。

(2)本集合计划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集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红。

(3)集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值。

(4)每一集合计划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。

#### **6.4.4.12 外币交易**

无。

#### **6.4.4.13 分部报告**

无。

#### **6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

本集合计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

## 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

财政部于2017年颁布了修订后的《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号一套期会计》及《企业会计准则第37号--金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,本集合计划自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于2024年颁布了修订后的《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>》,本集合计划的管理人已采用上述准则及通知编制本集合计划2024年中期财务报表。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款,主要税项列示如下:

### 1. 增值税

根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,通知自2018年1月1日起施行。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### 2. 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。

### 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、营业税的单位和個人，都应当依照規定繳納城市維護建設稅、教育費附加（除按照相關規定繳納農村教育事業費附加的單位外）及地方教育費附加。

#### 4. 個人所得稅

根據財政部、國家稅務總局財稅[2008]132號文《財政部、國家稅務總局關於儲蓄存款利息所得有關個人所得稅政策的通知》的規定，自2008年10月9日起，對儲蓄存款利息所得暫免徵收個人所得稅。

### 6.4.7 重要財務報表項目的說明

#### 6.4.7.1 貨幣資金

單位：人民幣元

項目	本期末 2024年06月30日
活期存款	504,104.37
等於：本金	503,979.58
加：應計利息	124.79
減：壞賬準備	-
定期存款	-
等於：本金	-
加：應計利息	-
減：壞賬準備	-
其中：存款期限1個月以內	-
存款期限1-3個月	-
存款期限3個月以上	-
其他存款	-
等於：本金	-
加：應計利息	-
減：壞賬準備	-
合計	504,104.37

#### 6.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末
----	-----

		2024年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		39,572,641.93	-	32,103,467.00	-7,469,174.93
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	24,451,211.40	259,961.36	24,197,286.96	-513,885.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	24,451,211.40	259,961.36	24,197,286.96	-513,885.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		64,023,853.33	259,961.36	56,300,753.96	-7,983,060.73

### 6.4.7.3 买入返售金融资产

#### 6.4.7.3.1 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 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	4,500,000.00	-

### 6.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,654.43

其中：交易所市场	3,654.43
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	3,481.66
预提费用-信息披露费	39,781.56
预提费用-账户维护费	9,300.00
合计	56,217.65

#### 6.4.7.5 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	74,845,112.98	74,845,112.98
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	74,845,112.98	74,845,112.98

#### 6.4.7.6 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-19,823,333.68	-1,389,079.07	-21,212,412.75
本期期初	-19,823,333.68	-1,389,079.07	-21,212,412.75
本期利润	734,819.25	-3,618,999.68	-2,884,180.43
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,088,514.43	-5,008,078.75	-24,096,593.18

#### 6.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	4,677.02
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	4,060.66
其他	151.20
合计	8,888.88

**6.4.7.8 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	16,176,484.33
减：卖出股票成本总额	15,838,030.38
减：交易费用	31,254.54
买卖股票差价收入	307,199.41

**6.4.7.9 债券投资收益****6.4.7.9.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	165,637.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	81,352.18
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	246,989.54

**6.4.7.9.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,341,042.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,245,308.41
减：应计利息总额	13,814.28
减：交易费用	567.24
买卖债券差价收入	81,352.18

**6.4.7.10 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	636,401.03
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	636,401.03

**6.4.7.11 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-3,618,999.68
——股票投资	-3,321,611.37
——债券投资	-297,388.31
——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	-3,618,999.68

#### 6.4.7.12 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	3,481.66
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
汇划手续费	810.00
帐户维护费	18,600.00
合计	62,673.22

#### 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，本集合计划无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本集合计划无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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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
天风（上海）证券资产管理有限公司	计划管理人、计划销售机构

天风证券股份有限公司	计划管理人的股东、计划销售机构
中信银行股份有限公司	计划托管人、计划销售机构

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

##### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
天风证券股份有限公司	25,604,611.05	100.00%	815,667,197.76	100.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
天风证券股份有限公司	14,182,960.25	100.00%	107,788,251.02	100.00%

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
天风证券 股份有限 公司	601,200,000.00	100.00%	594,000,000.00	100.00%

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
天风证券 股份有限 公司	18,676.62	100.00%	3,654.43	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
天风证券 股份有限 公司	595,929.41	100.00%	70,693.20	100.00%

### 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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	306,881.82	909,285.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	148,093.08	432,341.08
应支付基金管理人的净管理费	158,788.74	476,944.38

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年实际天数}$$

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	20,458.76	48,495.19

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年实际天数}$$

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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

本集合计划本报告期内无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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率证券出借业务。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本集合计划本报告期无集合计划管理人运用固有资金投资本集合计划的情况。

##### 6.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
天风证券股份有限公司	2,500,000.00	3.3402%	2,500,000.00	3.3402%

##### 6.4.10.6 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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
中信银行股份有限公司	504,104.37	4,677.02	1,543,111.79	49,518.37

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

#### **6.4.10.8 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**

本集合计划本报告期末未进行利润分配。

#### **6.4.12 期末（2024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**

本集合计划本报告期末未持有流通受限证券。

##### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本集合计划本报告期末未持有流通受限股票。

##### **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，本集合计划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2024年6月30日，本集合计划从事证券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为人民币11,000,000.00元，于2024年7月10日到期。该类交易要求本集合计划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。

#### **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**

本集合计划金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险及投资合规性风险。本集合计划管理人制定了相应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。

公司风险管理架构分为四个层次：第一层次为董事会以及监事会；第二层次为资产管理业务管理委员会及其下设的各委员会、首席风险官、合规总监；第三层次为风险管理部门，包括风险管理部、合规法务部、财务部、产品运营部、内核控制部及天风证券

品牌管理部、稽核审计部；第四层次为公司除风险管理部门之外的各部门及公司全体成员。各风险管理层级在各自的职责范围内履行风险管理的职责。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划的管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本集合计划的集合计划管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险，本集合计划投资于一家公司发行的证券市值不超过计划资产净值的10%，且本集合计划与由本集合计划管理人管理的其他集合计划共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。本集合计划债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	1,248,593.36	567,002.74
AAA以下	10,655,061.82	4,118,241.70
未评级	12,293,631.78	12,077,526.57
合计	24,197,286.96	16,762,771.01

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的集合计划份额，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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划的管理人于开放期内每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划的管理人在集合计划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模式带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人

利益。针对不能及时以合理价格进行变现的风险，管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在集合计划运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于集合计划开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本集合计划所持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。此外，本集合计划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。每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券占本集合计划资产净值的比例不低于5%。同时，本集合计划的管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本集合计划从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本集合计划的管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与集合计划合同约定的投资范围保持一致。综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本集合计划在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：利率风险、外汇风险、政策风险、经济周期风险、购买力风险、上市公司经营风险等。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划持仓中包含存款、交易所及银行间市场交易的固定收益品种等，因此存在相应的利率风险。本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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							
货币资金	504,104.37	-	-	-	-	-	504,104.37
结算备付金	754,878.20	-	-	-	-	-	754,878.20
存出保证金	6,031.24	-	-	-	-	-	6,031.24
交易性金融资产	-	-	841,326.44	21,589,042.71	1,766,917.81	32,103,467.00	56,300,753.96
买入返售金融资产	4,500,000.00	-	-	-	-	-	4,500,000.00
应收股利	-	-	-	-	-	28,253.82	28,253.82
资产总计	5,765,013.81	-	841,326.44	21,589,042.71	1,766,917.81	32,131,720.82	62,094,021.59
负债							
卖出回购金融资产款	11,010,388.16	-	-	-	-	-	11,010,388.16
应付清算款	-	-	-	-	-	213,479.77	213,479.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	51,669.16	51,669.16
应付托管费	-	-	-	-	-	3,444.60	3,444.60
应交税费	-	-	-	-	-	10,302.45	10,302.45
其他负债	-	-	-	-	-	56,217.65	56,217.65
负债总计	11,010,388.16	-	-	-	-	335,113.63	11,345,501.79
利率敏	-5,245,374.35	-	841,326.44	21,589,042.71	1,766,917.81	31,796,607.19	50,748,519.80

感度缺口							
上年度末 2023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							
货币资金	2,904,701.21	-	-	-	-	-	2,904,701.21
结算备付金	108,228.57	-	-	-	-	1,100.00	109,328.57
存出保证金	55,977.33	-	-	-	-	-	55,977.33
交易性金融资产	-	-	-	15,933,647.83	829,123.18	41,845,243.00	58,608,014.01
买入返售金融资产	4,999,660.54	-	-	-	-	-	4,999,660.54
应收清算款	-	-	-	-	-	133,382.18	133,382.18
资产总计	8,068,567.65	-	-	15,933,647.83	829,123.18	41,979,725.18	66,811,063.84
负债							
卖出回购金融资产款	11,003,230.20	-	-	-	-	-	11,003,230.20
应付清算款	-	-	-	-	-	1,967,539.75	1,967,539.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	66,549.82	66,549.82
应付托管费	-	-	-	-	-	3,619.68	3,619.68
应交税费	-	-	-	-	-	356.89	356.89
其他负债	-	-	-	-	-	137,067.27	137,067.27
负债总计	11,003,230.20	-	-	-	-	2,175,133.41	13,178,363.61
利率敏	-2,934,662.55	-	-	15,933,647.83	829,123.18	39,804,591.77	53,632,700.23

敏感度缺口							
-------	--	--	--	--	--	--	--

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	36,456.00	50,940.00
	市场利率上升25个基点	-37,440.00	-50,604.00

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,413,610.00	-	2,413,610.00
应收股利	-	28,253.82	-	28,253.82
资产合计	-	2,441,863.82	-	2,441,863.82
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,441,863.82	-	2,441,863.82
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计

			币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,205,902.00	-	2,205,902.00
资产合计	-	2,205,902.00	-	2,205,902.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,205,902.00	-	2,205,902.00

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指集合计划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。

本集合计划的集合计划管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用"自上而下"与"自下而上"相结合的策略,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合集合计划合同约定范围的投资品种进行投资。本集合计划的管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的市场价格风险。

本集合计划严格按照集合计划合同中对投资组合比例的要求进行资产配置,通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且,集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对集合计划进行风险度量,动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 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 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	32,103,467.00	63.26	41,845,243.00	78.02
交易性金融资	-	-	-	-

产—基金投资				
交易性金融资产—债券投资	24,197,286.96	47.68	16,762,771.01	31.25
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	56,300,753.96	110.94	58,608,014.01	109.28

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	44,007,122.18	46,530,487.44
第二层次	12,293,631.78	12,077,526.57
第三层次	-	-
合计	56,300,753.96	58,608,014.01

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本集合计划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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 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集合计划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	32,103,467.00	51.70
	其中：股票	32,103,467.00	51.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,197,286.96	38.97
	其中：债券	24,197,286.96	38.97
	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	4,500,000.00	7.25
	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	1,258,982.57	2.03
8	其他各项资产	34,285.06	0.06
9	合计	62,094,021.59	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	1,493,610.00	2.94
C	制造业	24,626,293.00	48.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,629,720.00	3.21
G	交通运输、仓储和邮政业	183,540.00	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,344,440.00	2.65
K	房地产业	262,800.00	0.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	149,454.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	29,689,857.00	58.50

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
非日常生活消费品	1,103,430.00	2.17
日常消费品	753,300.00	1.48
金融	176,800.00	0.35

医疗保健	168,480.00	0.33
信息技术	63,600.00	0.13
公用事业	148,000.00	0.29
合计	2,413,610.00	4.76

### 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	002557	洽洽食品	66,000	1,860,540.00	3.67
2	002727	一心堂	108,000	1,629,720.00	3.21
3	603589	口子窖	36,500	1,430,435.00	2.82
4	002706	良信股份	200,000	1,372,000.00	2.70
5	603868	飞科电器	34,000	1,305,600.00	2.57
6	603993	洛阳钼业	150,000	1,275,000.00	2.51
7	002594	比亚迪	4,900	1,226,225.00	2.42
8	002050	三花智控	57,000	1,087,560.00	2.14
9	300476	胜宏科技	32,000	1,032,320.00	2.03
10	603899	晨光股份	32,000	1,000,960.00	1.97
11	600584	长电科技	28,000	887,880.00	1.75
12	601601	中国太保	30,000	835,800.00	1.65
13	688630	芯碁微装	13,000	813,410.00	1.60
14	600887	伊利股份	30,000	775,200.00	1.53
15	000333	美的集团	12,000	774,000.00	1.53
16	600438	通威股份	40,000	764,400.00	1.51
17	H02367	巨子生物	18,000	753,300.00	1.48
18	H01368	特步国际	150,000	658,500.00	1.30
19	688268	华特气体	11,000	567,710.00	1.12
20	603195	公牛集团	7,250	559,120.00	1.10
21	603197	保隆科技	17,000	535,500.00	1.06

22	603348	文灿股份	19,000	526,110.00	1.04
23	688110	东芯股份	27,000	514,890.00	1.01
24	300014	亿纬锂能	12,000	479,040.00	0.94
25	301031	中熔电气	5,500	452,100.00	0.89
26	300745	欣锐科技	31,000	448,260.00	0.88
27	000887	中鼎股份	30,000	367,200.00	0.72
28	300680	隆盛科技	17,000	324,190.00	0.64
29	603733	仙鹤股份	18,000	316,440.00	0.62
30	300129	泰胜风能	45,000	306,900.00	0.60
31	300443	金雷股份	20,000	306,600.00	0.60
32	600919	江苏银行	40,000	297,200.00	0.59
33	688698	伟创电气	11,000	296,670.00	0.58
34	002271	东方雨虹	24,000	296,160.00	0.58
35	002304	洋河股份	3,500	282,590.00	0.56
36	600048	保利发展	30,000	262,800.00	0.52
37	000807	云铝股份	19,000	256,690.00	0.51
38	H03690	美团-W	2,500	253,500.00	0.50
39	002293	罗莱生活	30,000	242,400.00	0.48
40	603596	伯特利	6,000	233,400.00	0.46
41	688596	正帆科技	7,000	231,000.00	0.46
42	002572	索菲亚	15,000	229,950.00	0.45
43	002156	通富微电	10,000	223,900.00	0.44
44	688608	恒玄科技	1,500	219,570.00	0.43
45	002833	弘亚数控	12,000	218,880.00	0.43
46	601958	金钼股份	21,000	218,610.00	0.43
47	601166	兴业银行	12,000	211,440.00	0.42
48	600809	山西汾酒	1,000	210,880.00	0.42
49	603501	韦尔股份	2,000	198,740.00	0.39
50	600685	中船防务	7,000	195,300.00	0.38
51	H01910	新秀丽	9,000	191,430.00	0.38
52	603565	中谷物流	21,000	183,540.00	0.36

53	601058	赛轮轮胎	13,000	182,000.00	0.36
54	H01336	新华保险	13,000	176,800.00	0.35
55	H02269	药明生物	16,000	168,480.00	0.33
56	600765	中航重机	8,000	163,200.00	0.32
57	300138	晨光生物	18,000	151,740.00	0.30
58	688372	伟测科技	3,800	149,454.00	0.29
59	603345	安井食品	2,000	148,620.00	0.29
60	H02380	中国电力	40,000	148,000.00	0.29
61	002507	涪陵榨菜	12,000	147,000.00	0.29
62	300118	东方日升	9,000	108,900.00	0.21
63	603833	欧派家居	2,000	107,120.00	0.21
64	300866	安克创新	1,300	92,573.00	0.18
65	002532	天山铝业	10,000	81,100.00	0.16
66	003012	东鹏控股	12,000	73,320.00	0.14
67	H03800	协鑫科技	60,000	63,600.00	0.13

## 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	300014	亿纬锂能	452,358.00	0.84
2	002557	洽洽食品	406,320.00	0.76
3	603197	保隆科技	386,682.00	0.72
4	002304	洋河股份	325,987.00	0.61
5	688698	伟创电气	283,115.00	0.53
6	000807	云铝股份	279,400.00	0.52
7	002293	罗莱生活	269,300.00	0.50
8	H03690	美团-W	266,274.38	0.50
9	H01368	特步国际	266,024.52	0.50

10	002572	索菲亚	250,380.00	0.47
11	300443	金雷股份	242,920.00	0.45
12	601958	金钼股份	235,420.00	0.44
13	603596	伯特利	223,620.00	0.42
14	600765	中航重机	215,560.00	0.40
15	600809	山西汾酒	214,997.00	0.40
16	601166	兴业银行	207,700.00	0.39
17	H01910	新秀丽	200,949.22	0.37
18	603501	韦尔股份	200,280.00	0.37
19	688372	伟测科技	193,078.00	0.36
20	601058	赛轮轮胎	192,350.00	0.36

#### 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	603993	洛阳钼业	1,154,000.00	2.15
2	300476	胜宏科技	1,065,892.00	1.99
3	600036	招商银行	1,031,330.00	1.92
4	688608	恒玄科技	923,156.93	1.72
5	300724	捷佳伟创	783,006.00	1.46
6	002865	钧达股份	682,960.00	1.27
7	601601	中国太保	681,100.00	1.27
8	600919	江苏银行	677,000.00	1.26
9	605305	中际联合	658,330.00	1.23
10	600809	山西汾酒	595,260.00	1.11
11	H00700	腾讯控股	547,569.79	1.02
12	300294	博雅生物	543,310.00	1.01
13	000333	美的集团	520,490.00	0.97
14	000895	双汇发展	409,457.00	0.76

15	002156	通富微电	397,052.00	0.74
16	300680	隆盛科技	395,934.00	0.74
17	600021	上海电力	395,300.00	0.74
18	603565	中谷物流	384,315.00	0.72
19	H03690	美团-W	366,540.31	0.68
20	000963	华东医药	348,150.00	0.65

### 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	9,417,865.75
卖出股票收入（成交）总额	16,176,484.33

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	12,293,631.78	24.22
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)	11,903,655.18	23.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,197,286.96	47.68

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019723	23国债20	120,000	12,293,631.78	24.22

2	110085	通22转债	5,210	551,055.28	1.09
3	113675	新23转债	4,340	503,120.15	0.99
4	110062	烽火转债	4,000	470,042.19	0.93
5	127050	麒麟转债	3,000	402,946.85	0.79

#### 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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划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 本集合计划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，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本集合计划投资的前十名股票未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	6,031.24

2	应收清算款	-
3	应收股利	28,253.82
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,285.06

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110085	通22转债	551,055.28	1.09
2	113675	新23转债	503,120.15	0.99
3	110062	烽火转债	470,042.19	0.93
4	127050	麒麟转债	402,946.85	0.79
5	118014	高测转债	401,085.48	0.79
6	110086	精工转债	356,527.12	0.70
7	113527	维格转债	349,356.58	0.69
8	128136	立讯转债	342,588.90	0.68
9	118033	华特转债	335,309.18	0.66
10	128121	宏川转债	323,502.74	0.64
11	113639	华正转债	320,729.18	0.63
12	127089	晶澳转债	291,902.05	0.58
13	113629	泉峰转债	290,713.56	0.57
14	123216	科顺转债	286,116.16	0.56
15	110055	伊力转债	262,443.56	0.52
16	110090	爱迪转债	236,069.86	0.47
17	123179	立高转债	235,076.38	0.46
18	118045	盟升转债	231,680.00	0.46

19	123119	康泰转2	231,003.29	0.46
20	113519	长久转债	229,526.30	0.45
21	118013	道通转债	228,400.82	0.45
22	123158	宙邦转债	227,421.64	0.45
23	123133	佩蒂转债	226,006.58	0.45
24	127073	天赐转债	224,289.86	0.44
25	127085	韵达转债	220,197.53	0.43
26	127066	科利转债	218,200.82	0.43
27	113655	欧22转债	216,024.11	0.43
28	118023	广大转债	212,722.60	0.42
29	123154	火星转债	212,424.11	0.42
30	111014	李子转债	212,250.14	0.42
31	118042	奥维转债	211,416.16	0.42
32	113641	华友转债	202,937.53	0.40
33	128135	洽洽转债	200,937.19	0.40
34	128124	科华转债	196,222.47	0.39
35	118015	芯海转债	160,847.47	0.32
36	113619	世运转债	129,875.75	0.26
37	110075	南航转债	123,987.67	0.24
38	127090	兴瑞转债	123,387.40	0.24
39	118037	上声转债	119,295.89	0.24
40	113061	拓普转债	118,695.75	0.23
41	127045	牧原转债	118,359.18	0.23
42	127041	弘亚转债	115,209.86	0.23
43	123067	斯莱转债	113,909.45	0.22
44	127031	洋丰转债	112,502.74	0.22
45	128081	海亮转债	108,514.79	0.21
46	128095	恩捷转债	108,070.41	0.21
47	113670	金23转债	107,162.74	0.21
48	113647	禾丰转债	104,241.78	0.21
49	123176	精测转2	103,986.08	0.20

50	127049	希望转2	103,508.22	0.20
51	113033	利群转债	101,658.77	0.20
52	128108	蓝帆转债	91,097.67	0.18
53	123128	首华转债	70,763.01	0.14
54	127072	博实转债	59,788.15	0.12
55	118007	山石转债	48,546.03	0.10

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有流通受限股票。

## §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
1,418	52,782.17	2,502,970.30	3.34%	72,342,142.68	96.66%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	318,891.76	0.4261%

### 8.3 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	10~50
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(2021年08月30日)基金份额总额	1,419.85
本报告期期初基金份额总额	74,845,112.98
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	74,845,112.98

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 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

本报告期内，集合计划管理人的重大人事变动如下：自2024年1月31日起，蒋秋伟先生担任天风（上海）证券资产管理有限公司首席信息官。

本报告期内，集合计划托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本集合计划管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本集合计划投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本集合计划聘请的会计师事务所未发生改变。

### 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

本报告期内本集合计划管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	
天风证券	2	25,604,611.05	100.00%	18,676.62	100.00%	-

### 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
天风证券	14,182,960.25	100.00%	601,200,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 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	天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划招募说明书更新	公司网站及中国证监会指定网站	2024-02-28
2	天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	公司网站及中国证监会指定网站	2024-02-28
3	天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划基金经理变更公告	公司网站、中国证监会指定报刊及网站	2024-02-28
4	天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	公司网站及中国证监会指定网站	2024-06-28
5	关于天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划可	公司网站及中国证监会指定网站	2024-06-28

	能触发合同终止情形的提示性公告		
--	-----------------	--	--

## §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

本集合计划本报告期内无单一投资者持有集合计划份额比例达到或者超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本集合计划本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予天风证券天盈1号集合资产管理计划变更为天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划的文件
- 2.《天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划资产管理合同》
- 3.《天风天盈一年定期开放混合型集合资产管理计划托管协议》
- 4.法律意见书
- 5.管理人业务资格批件、营业执照
- 6.托管人业务资格批件、营业执照
- 7.中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

上述备查文件等文本存放在管理人的办公场所：上海市虹口区北外滩街道东大名路678号上海港国际客运中心6号楼5楼

### 12.3 查阅方式

网址：[www.tfzqam.com](http://www.tfzqam.com)

咨询电话：95391/400-800-5000

天风（上海）证券资产管理有限公司  
二〇二四年八月二十九日