

天治财富增长证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 27 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月24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2021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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§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遵规守信情况的说明.....	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.....	12
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遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 中期财务会计报告(未经审计).....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§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.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12 投资组合报告附注.....	62
§8 基金份额持有人信息.....	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
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.....	63
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
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.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天治财富增长证券投资基金
基金简称	天治财富增长混合
基金主代码	350001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年06月29日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	134,935,006.23份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在确保基金份额净值不低于本基金建立的动态资产保障线的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金建立随时间推移呈非负增长的动态资产保障线，以投资组合保险机制、VaR（Value at Risk）技术为核心工具，对风险性资产（股票）与低风险资产（债券）的投资比例进行动态调整，并结合下方风险来源分析，对基金的各项资产实施全流程的风险预算管理，力争使基金份额净值高于动态资产保障线水平。在风险可控的基础上，本基金通过积极投资，谋求最大限度地实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中风险较低、收益稳健的基金品种。

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	上海浦东发展银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	赵正中	胡波
	联系电话	021-60371155	021-61618888
	电子邮箱	zhaozz@chinanature.com.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-098-4800(免长途通 话费用)、021-60374800	95528
传真		021-60374934	021-63602540
注册地址		上海市浦东新区莲振路298号 4号楼231室	上海市中山东一路12号
办公地址		上海市复兴西路159号	上海市北京东路689号
邮政编码		200031	200001
法定代表人		单宇	郑杨

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.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	天治基金管理有限公司	上海市徐汇区复兴西路159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 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
	本期已实现收益

本期利润	14,859,057.00
加权平均基金份额本期利润	0.0817
本期加权平均净值利润率	5.06%
本期基金份额净值增长率	6.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	89,019,743.62
期末可供分配基金份额利润	0.6597
期末基金资产净值	223,954,749.85
期末基金份额净值	1.6597
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	582.55%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.44%	0.40%	-0.69%	0.33%	2.13%	0.07%
过去三个月	3.87%	0.34%	2.24%	0.39%	1.63%	-0.05%
过去六个月	6.43%	0.57%	1.73%	0.53%	4.70%	0.04%
过去一年	23.27%	1.07%	11.94%	0.53%	11.33%	0.54%
过去三年	44.22%	1.18%	29.94%	0.54%	14.28%	0.64%
自基金合同	582.55%	2.05%	235.01%	0.87%	347.5	1.18%

生效起至今					4%	
-------	--	--	--	--	----	--

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

天治财富增长证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2004年06月29日-2021年06月30日)



3.3 其他指标

注：无。

§ 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2021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——天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）、天治天得利货币市场基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、天治可转债增强债券型证券投资基金、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金（转型自2011

年12月28日生效的天治稳定收益债券型证券投资基金)、天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金(转型自2008年5月8日生效的天治创新先锋混合型证券投资基金)、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金(转型自2005年1月12日生效的天治品质优选混合型证券投资基金)、天治新消费灵活配置混合型证券投资基金(转型自2011年8月4日生效的天治成长精选混合型证券投资基金)、天治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、天治稳健双鑫债券型证券投资基金分别于2006年1月20日、2006年7月5日、2008年11月5日、2009年7月15日、2013年6月4日、2015年6月9日、2016年4月7日、2016年4月18日、2016年7月6日、2019年3月7日、2019年5月21日、2019年6月11日、2019年11月20日生效。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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、天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理	2019-07-23	-	16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
李申	产品开发与金融工程部总监、本基金基金经理	2021-04-15	-	7年	硕士研究生,具有基金从业资格。2014年4月至2015年9月于日发资产管理(上海)有限公司任高级研究员。2015年10月加入天治基金管理有限公司,历任产品开发与金融工程部金

					融工程研究员、总监助理、副总监，现任产品开发与金融工程部总监。
--	--	--	--	--	---------------------------------

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，国内经济复苏持续，但呈现出明显的非均衡特征，主要表现为需求复苏弱于生产，内需弱于外需，增长动能逐渐趋缓，局部地区疫情反复在一定程度上也造成了经济增长的扰动。货币政策方面“稳”字当头，坚持不搞“大水漫灌”，上半年金融市场流动性整体偏宽松，但消费仍处于弱复苏状态，生猪供给量的增加造成了生猪价格的大幅度持续下跌，从而对冲了原油、煤炭等大宗商品价格上涨带来的输入性通胀，CPI整体保持在较低水平。海外方面，欧美经济平稳复苏，新增就业和失业率逐月改善，但通货膨胀的居高不下，引发了市场对美联储货币政策的强烈关注，Taper进程成为市场热点，上半年美债收益率先上后下，美联储虽然维持鸽派发言，但美债和美股的波动加大显示市场仍存担忧。

A股主要指数方面，上半年上证综指上涨3.40%，沪深300上涨0.24%，创业板指上涨17.22%。

整体来看，2021年开年以来，A股首先经过了一轮“春季躁动”行情，其后受美国经济复苏预期和通胀预期升温影响，美债利率大幅上行，前期涨幅较大的“抱团股”在春节后出现较大幅度调整，带动各主要指数下行。2季度A股经过短暂的筑底后，以创业板和科创板为代表的成长股板块率先走出底部震荡区间，以白酒、医药、电力设备及新能源为代表的高景气行业先后创出新高，半导体、军工等主题行业表现活跃，赚钱效应明显；相比之下，以银行、非银、地产、家电为代表的传统行业表现低迷，部分头部传统蓝筹公司甚至在触发回购后股价仍迭创新低，成长价值板块间表现分化明显，投资者对高增长高景气板块的估值容忍度明显高于低估值板块。从资金面来看，新基金经历了3、4月份的短暂低迷，在市场重新出现了赚钱效应后，发行逐渐回暖，场内资金结构较好，机构仍占据较强话语权。以原油、煤炭为代表的大宗商品价格大幅上涨，相关行业个股盈利预期确定性较强，周期行业个股表现亦可圈可点。

本基金上半年坚持了追求绝对收益的“固收+”策略，力争以较小的最大回撤创造较高的绝对回报，重点精选沪深300中估值相对较低的核心标的以及收益久期匹配的利率债、高等级信用债、可交换债等，并积极参与网下新股申购。在仓位管理方面，根据估值和市场情绪动态调整股票仓位，市场波动明显偏大时维持较低仓位运作策略；在权益方面，继续深入进行公司基本面研究，挖掘具备长线价值个股，力争权益组合部分跑赢沪深300指数；在债券方面，紧密跟踪海外及国内经济复苏和通胀多重因素扰动，围绕利率窄幅震荡区间动态调整利率债久期，波段操作进行收益增厚操作，在利率走势尚不明确的情况下，久期维持较低水平，品种上以利率债和可交换债配置为主，较少配置信用债；在杠杆策略上，保持了以交易所为主的正回购进行收益增厚操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末天治财富增长混合基金份额净值为1.6597元，本报告期内，基金份额净值增长率为6.43%，同期业绩比较基准收益率为1.73%，高于同期业绩比较基准收益率4.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年在地产收紧调控、基建发力空间有限的情况下，经济维持高增速难度较大，利率上行空间有限；另一方面，PPI维持在高位，大宗商品供给端没有明显缓解，房地产销售额同比仍高，在出口保持韧性、内需逐步改善的条件下，货币政策难以大幅宽松。海外方面，美国通胀和就业数据一定程度上影响了美国金融市场主要资产定价，从而进一步影响了全球风险偏好，美股高位震荡和较高的估值水平仍是潜在的不确定性风险。美联储向市场释放Taper信号，美债收益率或将快速上行，可能对美股和新兴市场股票、债券、汇率造成一定冲击，这一预期值得持续观察和保持警惕。

受限于库存周期、通胀、流动性以及海外疫情等因素，本轮全面上涨行情或已渐入尾声，预计下半年A股以结构性机会为主，高估值成长板块或阶段性伴随利率上行波段发生估值收敛；结构上，下半年A股投资要继续淡化指数，注重赛道和板块选择，由于政策和盈利的双重加持，在偏宽松的流动性预期不变的前提下，将支持高景气的成长板块或继续“抱团式”提升估值，存在较好的弹性博收益机会，但风险与收益并存，而低估值蓝筹板块如银行、保险、房地产、家电交运等板块在经济持续复苏、消费需求提升后，已经迎来较好的长期配置价值。

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。基金结算部人员均具备基金从业资格和会计专业工作经历。为确保基金资产估值的公平、合理、合规，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了天治基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了有关议事规则。估值委员会成员包括公司投资决策委员会成员、负责基金结算的管理层、监察稽核部总监、产品开发与金融工程部总监等，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对于权益投资部、固定收益部及产品开发与金融工程部提交的估值模型和估值结果进行论证审核，并签署最终意见。基金经理会参与估值，与产品开发与金融工程部一同根据估值模型、估值程序计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，将估值结果提交公司估值委员会。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的

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

4.7 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

报告期内，本基金不存在基金持有人数少于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§ 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对天治财富增长证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对天治财富增长证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由天治基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：天治财富增长证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,910,124.72	17,148,809.31
结算备付金		5,174,750.42	2,007,022.55
存出保证金		102,672.36	191,926.04
交易性金融资产	6.4.7.2	282,918,272.06	250,430,957.34
其中：股票投资		116,406,543.66	133,979,602.44
基金投资		-	-
债券投资		166,511,728.40	116,451,354.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	20,000,230.00
应收证券清算款		5,868,169.38	267,343.94
应收利息	6.4.7.5	2,578,980.56	1,451,111.59
应收股利		-	-
应收申购款		60,852.97	906.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		311,613,822.47	291,498,307.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		79,800,000.00	72,000,000.00
应付证券清算款		7,059,546.03	-

应付赎回款		61,265.74	251,426.52
应付管理人报酬		309,581.56	253,279.09
应付托管费		51,596.94	42,213.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	288,260.68	385,985.16
应交税费		1,298.20	-
应付利息		-	20,682.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	87,523.47	166,224.25
负债合计		87,659,072.62	73,119,810.94
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	134,935,006.23	140,030,657.54
未分配利润	6.4.7.10	89,019,743.62	78,347,839.06
所有者权益合计		223,954,749.85	218,378,496.60
负债和所有者权益总计		311,613,822.47	291,498,307.54

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值1.6597元，基金份额总额134,935,006.23份。

6.2 利润表

会计主体：天治财富增长证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021年01月01日至 2021年06月30日	2020年01月01日至2020年06月30日
一、收入		19,349,351.17	-4,122,810.29
1. 利息收入		2,541,499.58	563,590.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	179,139.86	47,344.51
债券利息收入		2,310,705.07	516,245.70
资产支持证券利息		-	-

收入			
买入返售金融资产收入		51,654.65	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		24,154,825.00	-2,394,252.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	22,027,683.54	-374,868.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,045,833.61	-2,077,102.26
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,081,307.85	57,718.64
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,682,543.98	-2,300,209.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	335,570.57	8,061.04
减：二、费用		4,490,294.17	3,011,063.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	2,180,929.43	764,618.10
2. 托管费	6.4.10.2. 2	363,488.27	127,436.28
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	631,081.56	1,874,710.92
5. 利息支出		1,213,392.85	151,925.98
其中：卖出回购金融资产 支出		1,213,392.85	151,925.98

6. 税金及附加		536.79	61.11
7. 其他费用	6.4.7.20	100,865.27	92,310.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,859,057.00	-7,133,873.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,859,057.00	-7,133,873.42

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治财富增长证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	140,030,657.54	78,347,839.06	218,378,496.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,859,057.00	14,859,057.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-5,095,651.31	-4,187,152.44	-9,282,803.75
其中：1. 基金申购款	136,397,393.27	84,515,475.60	220,912,868.87
2. 基金赎回款	-141,493,044.58	-88,702,628.04	-230,195,672.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益	134,935,006.23	89,019,743.62	223,954,749.85

(基金净值)			
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	75,199,445.96	33,517,473.23	108,716,919.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,133,873.42	-7,133,873.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-5,361,409.64	-2,191,876.05	-7,553,285.69
其中: 1. 基金申购款	2,659,099.17	1,063,832.59	3,722,931.76
2. 基金赎回款	-8,020,508.81	-3,255,708.64	-11,276,217.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	69,838,036.32	24,191,723.76	94,029,760.08

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

天治财富增长证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]70号文《关于同意天治财富增长证券投资

基金设立的批复》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2004年6月29日正式生效，首次设立募集规模为952,004,756.57份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为天治基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的各种股票、存托凭证、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在资产配置中股票及存托凭证投资比例范围为基金资产净值的0-70%，债券投资比例范围为基金资产净值的20%-100%。今后在有关法律法规许可时，本基金将降低债券投资比例范围的下限，相应提高股票投资比例范围的上限。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%。

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（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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2021年6月30日的财务状况以及2021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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与2020年年度报告一致。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

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，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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	
	2021年06月30日	
活期存款	14,910,124.72	
定期存款	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
合计	14,910,124.72	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	116,963,981.77	116,406,543.66	-557,438.11	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	141,143,905.41	141,465,728.40	321,822.99
	银行间市场	25,029,868.15	25,046,000.00	16,131.85
	合计	166,173,773.56	166,511,728.40	337,954.84
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	283,137,755.33	282,918,272.06	-219,483.27	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	3,653.65
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,095.74
应收债券利息	2,573,189.59
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	41.58
合计	2,578,980.56

注：此处其他列示的是应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日

交易所市场应付交易费用	287,073.18
银行间市场应付交易费用	1,187.50
合计	288,260.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	215.51
应付证券出借违约金	-
预提审计费等	76,863.46
其他	10,444.50
合计	87,523.47

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	140,030,657.54	140,030,657.54
本期申购	136,397,393.27	136,397,393.27
本期赎回（以“-”号填列）	-141,493,044.58	-141,493,044.58
本期末	134,935,006.23	134,935,006.23

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	90,700,346.85	-12,352,507.79	78,347,839.06
本期利润	22,541,600.98	-7,682,543.98	14,859,057.00
本期基金份额交易产	-8,192,905.49	4,005,753.05	-4,187,152.44

生的变动数			
其中：基金申购款	94,737,346.27	-10,221,870.67	84,515,475.60
基金赎回款	-102,930,251.76	14,227,623.72	-88,702,628.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	105,049,042.34	-16,029,298.72	89,019,743.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	145,468.34
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	32,488.23
其他	1,183.29
合计	179,139.86

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	214,026,388.87
减：卖出股票成本总额	191,998,705.33
买卖股票差价收入	22,027,683.54

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,045,833.61

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	1,045,833.61

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	487,694,460.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	478,641,999.81
减：应收利息总额	8,006,627.26
买卖债券差价收入	1,045,833.61

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

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

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益—申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益—其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,081,307.85
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	1,081,307.85

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-7,682,543.98
——股票投资	-7,885,432.74
——债券投资	202,888.76
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-7,682,543.98

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	306,477.64
转换费收入	29,092.93
合计	335,570.57

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	628,569.06
银行间市场交易费用	2,512.50
合计	631,081.56

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	5,401.81
账户维护费	18,000.00
其他	600.00

合计	100,865.27
----	------------

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、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,180,929.43	764,618.10
其中：支付销售机构的客户维护费	198,395.93	71,903.62

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	363,488.27	127,436.28

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

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	21,700,204.39	21,700,204.39
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	21,700,204.39	21,700,204.39
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.08%	31.07%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、本基金管理人运用固有资金投资本基金的费率标准与其他相同条件投资者适用的费率先一致。

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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
上海浦东发展银行股份有限公司	14,910,124.72	145,468.34	6,055,105.54	29,779.13

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——按摊余成本法核算的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（2021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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688687	凯因科技	2021-01-29	2021-08-09	新股限售	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	注
688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	新股限售	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	注
688639	华恒生物	2021-04-14	2021-10-22	新股限售	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	注
6884	利元	2021	2021	认购	38.8	38.8	2,149	83,4	83,4	-

99	亨	-06- 23	-07- 01	新发 证券	5	5		88.6 5	88.6 5	
6886 76	金盘 科技	2021 -03- 02	2021 -09- 09	新股 限售	10.1 0	16.2 4	3,750	37,8 75.0 0	60,9 00.0 0	注
6886 11	杭州 柯林	2021 -04- 01	2021 -10- 12	新股 限售	33.4 4	42.3 4	1,400	46,8 16.0 0	59,2 76.0 0	注
6883 59	三孚 新科	2021 -05- 14	2021 -11- 22	新股 限售	11.0 3	26.3 5	2,213	24,4 09.3 9	58,3 12.5 5	注
3010 18	申菱 环境	2021 -06- 28	2021 -07- 07	认购 新发 证券	8.29	8.29	7,029	58,2 70.4 1	58,2 70.4 1	-
6882 39	航宇 科技	2021 -06- 25	2021 -07- 05	认购 新发 证券	11.4 8	11.4 8	4,926	56,5 50.4 8	56,5 50.4 8	-
3009 79	华利 集团	2021 -04- 15	2021 -10- 26	新股 限售	33.2 2	87.5 0	638	21,1 94.3 6	55,8 25.0 0	注
6880 87	英科 再生	2021 -06- 30	2021 -07- 09	认购 新发 证券	21.9 6	21.9 6	2,469	54,2 19.2 4	54,2 19.2 4	-
6882 60	昀冢 科技	2021 -03- 25	2021 -10- 08	新股 限售	9.63	16.4 1	2,990	28,7 93.7 0	49,0 65.9 0	注
3010 17	漱玉 平民	2021 -06- 23	2021 -07- 05	认购 新发 证券	8.86	8.86	4,995	44,2 55.7 0	44,2 55.7 0	-
3009 73	立高 食品	2021 -04- 08	2021 -10- 15	新股 限售	28.2 8	115. 71	360	10,1 80.8 0	41,6 55.6 0	注
3010	密封	2021	2021	认购	10.6	10.6	3,789	40,3	40,3	-

20	科技	-06- 28	-07- 06	新发 证券	4	4		14.9 6	14.9 6	
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2021 -07- 06	认购 新发 证券	9.46	9.46	2,609	24,6 81.1 4	24,6 81.1 4	-
3009 53	震裕 科技	2021 -03- 11	2021 -09- 22	新股 限售	28.7 7	99.8 5	240	6,90 4.80	23,9 64.0 0	注
3010 09	可靠 股份	2021 -06- 08	2021 -12- 17	新股 限售	12.5 4	27.8 9	801	10,0 44.5 4	22,3 39.8 9	注
3009 41	创识 科技	2021 -02- 02	2021 -08- 09	新股 限售	21.3 1	49.9 4	399	8,50 2.69	19,9 26.0 6	注
3010 15	百洋 医药	2021 -06- 22	2021 -12- 30	新股 限售	7.64	38.8 3	462	3,52 9.68	17,9 39.4 6	注
6882 26	威腾 电气	2021 -06- 28	2021 -07- 07	认购 新发 证券	6.42	6.42	2,693	17,2 89.0 6	17,2 89.0 6	-
3009 82	苏文 电能	2021 -04- 19	2021 -10- 27	新股 限售	15.8 3	45.2 9	317	5,01 8.11	14,3 56.9 3	注
3009 68	格林 精密	2021 -04- 06	2021 -10- 15	新股 限售	6.87	12.0 7	1,162	7,98 2.94	14,0 25.3 4	注
3009 40	南极 光	2021 -01- 27	2021 -08- 03	新股 限售	12.7 6	43.3 8	307	3,91 7.32	13,3 17.6 6	注
3006 14	百川 畅银	2021 -05- 18	2021 -11- 25	新股 限售	9.19	40.3 8	329	3,02 3.51	13,2 85.0 2	注
3009	药易	2021	2021	新股	12.2	53.7	244	2,98	13,1	注

37	购	-01- 20	-07- 27	限售	5	1		9.00	05.2 4	
3010 13	利和 兴	2021 -06- 21	2021 -12- 29	新股 限售	8.72	27.1 1	471	4,10 7.12	12,7 68.8 1	注
3009 42	易瑞 生物	2021 -02- 02	2021 -08- 09	新股 限售	5.31	28.5 2	443	2,35 2.33	12,6 34.3 6	注
3009 97	欢乐 家	2021 -05- 26	2021 -12- 02	新股 限售	4.94	13.0 5	928	4,58 4.32	12,1 10.4 0	注
3009 33	中辰 股份	2021 -01- 15	2021 -07- 22	新股 限售	3.37	10.4 4	1,112	3,74 7.44	11,6 09.2 8	注
3010 02	崧盛 股份	2021 -05- 27	2021 -12- 07	新股 限售	18.7 1	57.6 2	201	3,76 0.71	11,5 81.6 2	注
6052 87	德才 股份	2021 -06- 28	2021 -07- 06	认购 新发 证券	31.5 6	31.5 6	349	11,0 14.4 4	11,0 14.4 4	-
3009 55	嘉亨 家化	2021 -03- 16	2021 -09- 24	新股 限售	16.5 3	46.0 7	232	3,83 4.96	10,6 88.2 4	注
3009 96	普联 软件	2021 -05- 26	2021 -12- 03	新股 限售	20.8 1	42.2 3	241	5,01 5.21	10,1 77.4 3	注
3009 62	中金 辐照	2021 -03- 29	2021 -10- 11	新股 限售	3.40	16.3 7	576	1,95 8.40	9,42 9.12	注
3009 52	恒辉 安防	2021 -03- 03	2021 -09- 13	新股 限售	11.7 2	27.0 8	340	3,98 4.80	9,20 7.20	注
3010	雷尔	2021	2021	新股	13.7	32.9	275	3,78	9,06	注

16	伟	-06- 23	-12- 30	限售	5	8		1.25	9.50	
3009 66	共同 药业	2021 -03- 31	2021 -10- 11	新股 限售	8.24	31.5 4	286	2,35 6.64	9,02 0.44	注
3009 45	曼卡 龙	2021 -02- 03	2021 -08- 10	新股 限售	4.56	18.8 8	474	2,16 1.44	8,94 9.12	注
3009 48	冠中 生态	2021 -02- 18	2021 -08- 25	新股 限售	8.67	27.4 2	324	2,80 8.00	8,88 4.08	注
3009 31	通用 电梯	2021 -01- 13	2021 -07- 21	新股 限售	4.31	13.1 1	672	2,89 6.32	8,80 9.92	注
3009 61	深水 海纳	2021 -03- 23	2021 -09- 30	新股 限售	8.48	22.0 7	394	3,34 1.12	8,69 5.58	注
3009 50	德固 特	2021 -02- 24	2021 -09- 03	新股 限售	8.41	39.1 3	219	1,84 1.79	8,56 9.47	注
6051 62	新中 港	2021 -06- 29	2021 -07- 07	认购 新发 证券	6.07	6.07	1,377	8,35 8.39	8,35 8.39	-
3009 86	志特 新材	2021 -04- 21	2021 -11- 01	新股 限售	14.7 9	30.5 7	264	3,90 4.56	8,07 0.48	注
3009 87	川网 传媒	2021 -04- 28	2021 -11- 11	新股 限售	6.79	26.8 1	301	2,04 3.79	8,06 9.81	注
3009 78	东箭 科技	2021 -04- 15	2021 -10- 26	新股 限售	8.42	13.6 0	593	4,99 3.06	8,06 4.80	注
3009	博俊	2020	2021	新股	10.7	22.2	359	3,86	7,96	注

26	科技	-12- 29	-07- 07	限售	6	0		2.84	9.80	
3009 93	玉马 遮阳	2021 -05- 17	2021 -11- 24	新股 限售	12.1 0	19.2 9	410	4,96 1.00	7,90 8.90	注
3009 30	屹通 新材	2021 -01- 13	2021 -07- 21	新股 限售	13.1 1	24.4 8	322	4,22 1.42	7,88 2.56	注
3009 85	致远 新能	2021 -04- 21	2021 -10- 29	新股 限售	24.9 0	24.8 1	295	7,34 5.50	7,31 8.95	注
3009 71	博亚 精工	2021 -04- 07	2021 -10- 15	新股 限售	18.2 4	28.2 9	245	4,46 8.80	6,93 1.05	注
3010 04	嘉益 股份	2021 -06- 18	2021 -12- 27	新股 限售	7.81	21.9 4	312	2,43 6.72	6,84 5.28	注
3009 91	创益 通	2021 -05- 12	2021 -11- 22	新股 限售	13.0 6	26.5 1	254	3,31 7.24	6,73 3.54	注
3009 27	江天 化学	2020 -12- 29	2021 -07- 07	新股 限售	13.3 9	30.1 0	217	2,90 5.63	6,53 1.70	注
3010 18	申菱 环境	2021 -06- 28	2022 -01- 06	新股 限售	8.29	8.29	782	6,48 2.78	6,48 2.78	注
3009 75	商络 电子	2021 -04- 14	2021 -10- 21	新股 限售	5.48	13.0 3	492	2,69 6.16	6,41 0.76	注
3009 63	中洲 特材	2021 -03- 30	2021 -10- 11	新股 限售	12.1 3	22.4 9	283	3,43 2.79	6,36 4.67	注
3010	华立	2021	2021	新股	14.2	33.8	175	2,48	5,92	注

11	科技	-06-09	-12-17	限售	0	4		5.00	2.00	
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	注
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	注
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	注
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	新股限售	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	注
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	注
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-04	新股限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	注
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-05	新股限售	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	注
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	注
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	注
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	注
3010	扬电	2021	2021	新股	8.05	24.2	170	1,36	4,12	注

12	科技	-06-15	-12-22	限售		6		8.50	4.20	
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	注
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	注
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-05	新股限售	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	注

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	认购新发证券	100.00	100.00	1,350	135,000.00	135,000.00	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项停	5.59	2021-07-06	6.15	27,300	208,299.00	152,607.00	-

			牌							
--	--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

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2021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2021年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币79,800,000.00元，于2021年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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 2021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	14,910,124.72	-	-	-	-	-	14,910,124.72
结算备	5,174,750.42	-	-	-	-	-	5,174,750.42

付金							
存出保证金	102,672.36	-	-	-	-	-	102,672.36
交易性金融资产	40,004,000.00	15,008,000.00	89,178,528.40	22,321,200.00	-	116,406,543.66	282,918,272.06
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,868,169.38	5,868,169.38
应收利息	-	-	-	-	-	2,578,980.56	2,578,980.56
应收申购款	-	-	-	-	-	60,852.97	60,852.97
资产总计	60,191,547.50	15,008,000.00	89,178,528.40	22,321,200.00	-	124,914,546.57	311,613,822.47
负债							
卖出回购金融资产款	79,800,000.00	-	-	-	-	-	79,800,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,059,546.03	7,059,546.03
应付赎回款	-	-	-	-	-	61,265.74	61,265.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	309,581.56	309,581.56
应付托管费	-	-	-	-	-	51,596.94	51,596.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	288,260.68	288,260.68
应交税费	-	-	-	-	-	1,298.20	1,298.20
其他负债	-	-	-	-	-	87,523.47	87,523.47
负债总计	79,800,000.00	-	-	-	-	7,859,072.62	87,659,072.62
利率敏感度缺口	-19,608,452.50	15,008,000.00	89,178,528.40	22,321,200.00	-	117,055,473.95	223,954,749.85
上年度末 2020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	17,148,809.31	-	-	-	-	-	17,148,809.31
结算备付金	2,007,022.55	-	-	-	-	-	2,007,022.55
存出保证金	191,926.04	-	-	-	-	-	191,926.04

交易性金融资产	14,729,526.90	15,793,680.00	85,928,148.00	-	-	133,979,602.44	250,430,957.34
买入返售金融资产	20,000,230.00	-	-	-	-	-	20,000,230.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	267,343.94	267,343.94
应收利息	-	-	-	-	-	1,451,111.59	1,451,111.59
应收申购款	-	-	-	-	-	906.77	906.77
资产总计	54,077,514.80	15,793,680.00	85,928,148.00	-	-	135,698,964.74	291,498,307.54
负债							
卖出回购金融资产款	72,000,000.00	-	-	-	-	-	72,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	251,426.52	251,426.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	253,279.09	253,279.09
应付托管费	-	-	-	-	-	42,213.17	42,213.17
应付交易费用	-	-	-	-	-	385,985.16	385,985.16
应付利息	-	-	-	-	-	20,682.75	20,682.75
其他负债	-	-	-	-	-	166,224.25	166,224.25
负债总计	72,000,000.00	-	-	-	-	1,119,810.94	73,119,810.94
利率敏感度缺口	-17,922,485.20	15,793,680.00	85,928,148.00	-	-	134,579,153.80	218,378,496.60

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日

	利率上升25个基点	-180,444.10	-122,292.33
	利率下降25个基点	180,444.10	122,292.33

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 2021年06月30日		上年度末 2020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	116,406,543.66	51.98	133,979,602.44	61.35
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	166,511,728.40	74.35	116,451,354.90	53.33
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	282,918,272.06	126.33	250,430,957.34	114.68
----	----------------	--------	----------------	--------

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	861,342.87	24,901,482.97
	业绩比较基准变动-5%	-861,342.87	-24,901,482.97

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 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	116,406,543.66	37.36
	其中：股票	116,406,543.66	37.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	166,511,728.40	53.44
	其中：债券	166,511,728.40	53.44
	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	20,084,875.14	6.45
8	其他各项资产	8,610,675.27	2.76
9	合计	311,613,822.47	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

金额单位：人民币元

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	1,604,178.08	0.72
B	采矿业	8,125,721.00	3.63
C	制造业	49,413,916.97	22.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,722,295.39	0.77
E	建筑业	1,454,596.37	0.65
F	批发和零售业	1,292,826.78	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	8,138,343.40	3.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,181,999.70	2.76
J	金融业	29,920,214.78	13.36
K	房地产业	6,408,730.00	2.86
L	租赁和商务服务业	345,245.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	113,670.80	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	154,586.00	0.07
Q	卫生和社会工作	1,004,675.06	0.45
R	文化、体育和娱乐业	489,272.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	116,406,543.66	51.98

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	002475	立讯精密	100,000	4,600,000.00	2.05
2	601318	中国平安	66,600	4,281,048.00	1.91
3	000002	万科A	170,200	4,052,462.00	1.81
4	000651	格力电器	74,000	3,855,400.00	1.72
5	002352	顺丰控股	55,600	3,764,120.00	1.68
6	601398	工商银行	444,000	2,295,480.00	1.02
7	600030	中信证券	90,000	2,244,600.00	1.00
8	601288	农业银行	666,000	2,017,980.00	0.90
9	601857	中国石油	370,000	1,957,300.00	0.87
10	600028	中国石化	444,000	1,935,840.00	0.86
11	601995	中金公司	30,000	1,845,000.00	0.82
12	600009	上海机场	37,000	1,780,810.00	0.80
13	000703	恒逸石化	147,968	1,768,217.60	0.79
14	000063	中兴通讯	52,600	1,747,898.00	0.78
15	600446	金证股份	120,000	1,732,800.00	0.77
16	600887	伊利股份	44,400	1,635,252.00	0.73
17	000333	美的集团	22,200	1,584,414.00	0.71
18	002624	完美世界	60,000	1,434,600.00	0.64
19	600547	山东黄金	74,000	1,422,280.00	0.64
20	601988	中国银行	429,200	1,321,936.00	0.59
21	600036	招商银行	22,200	1,203,018.00	0.54
22	002714	牧原股份	19,740	1,200,586.80	0.54
23	601688	华泰证券	75,000	1,185,000.00	0.53

24	600048	保利地产	96,200	1,158,248.00	0.52
25	000338	潍柴动力	64,000	1,143,680.00	0.51
26	600426	华鲁恒升	36,500	1,129,675.00	0.50
27	600919	江苏银行	148,000	1,050,800.00	0.47
28	600703	三安光电	32,600	1,044,830.00	0.47
29	600519	贵州茅台	500	1,028,350.00	0.46
30	600988	赤峰黄金	66,600	998,334.00	0.45
31	000001	平安银行	43,500	983,970.00	0.44
32	000725	京东方 A	148,000	923,520.00	0.41
33	002050	三花智控	38,000	911,240.00	0.41
34	000983	西山煤电	108,000	897,480.00	0.40
35	000858	五粮液	3,000	893,670.00	0.40
36	600999	招商证券	44,000	836,880.00	0.37
37	300772	运达股份	45,000	819,450.00	0.37
38	003816	中国广核	296,000	790,320.00	0.35
39	601939	建设银行	118,400	787,360.00	0.35
40	000776	广发证券	51,800	784,252.00	0.35
41	002415	海康威视	11,800	761,100.00	0.34
42	600115	中国东航	148,000	751,840.00	0.34
43	600276	恒瑞医药	10,800	734,076.00	0.33
44	600690	海尔智家	26,800	694,388.00	0.31
45	000166	申万宏源	148,000	692,640.00	0.31
46	601816	京沪高铁	115,500	610,995.00	0.27
47	601166	兴业银行	27,400	563,070.00	0.25
48	300124	汇川技术	7,500	556,950.00	0.25
49	000783	长江证券	74,000	541,680.00	0.24
50	000157	中联重科	58,200	537,768.00	0.24
51	600570	恒生电子	5,400	503,550.00	0.22
52	002230	科大讯飞	7,400	500,092.00	0.22
53	600958	东方证券	50,000	499,500.00	0.22
54	002508	老板电器	10,400	483,600.00	0.22

55	600900	长江电力	23,300	480,912.00	0.21
56	002129	中环股份	12,100	467,060.00	0.21
57	600588	用友网络	14,000	465,640.00	0.21
58	300568	星源材质	10,993	454,780.41	0.20
59	000100	TCL科技	59,300	453,645.00	0.20
60	601668	中国建筑	95,200	442,680.00	0.20
61	002966	苏州银行	60,000	441,000.00	0.20
62	002493	荣盛石化	24,300	419,661.00	0.19
63	300142	沃森生物	6,800	419,560.00	0.19
64	002241	歌尔股份	9,600	410,304.00	0.18
65	002311	海大集团	4,900	399,840.00	0.18
66	002736	国信证券	37,000	397,750.00	0.18
67	688111	金山办公	1,000	394,800.00	0.18
68	300498	温氏股份	27,300	392,301.00	0.18
69	601601	中国太保	13,400	388,198.00	0.17
70	002557	洽洽食品	9,000	387,900.00	0.17
71	000661	长春高新	1,000	387,000.00	0.17
72	603501	韦尔股份	1,200	386,400.00	0.17
73	601919	中远海控	12,600	384,804.00	0.17
74	000425	徐工机械	59,900	381,563.00	0.17
75	688036	传音控股	1,800	377,100.00	0.17
76	601211	国泰君安	21,700	371,938.00	0.17
77	002727	一心堂	11,200	370,832.00	0.17
78	600104	上汽集团	16,700	366,899.00	0.16
79	600585	海螺水泥	8,700	357,135.00	0.16
80	002939	长城证券	31,800	353,934.00	0.16
81	600584	长电科技	9,300	350,424.00	0.16
82	688126	沪硅产业	12,000	350,160.00	0.16
83	601328	交通银行	71,300	349,370.00	0.16
84	002841	视源股份	2,800	348,012.00	0.16
85	300015	爱尔眼科	4,797	340,491.06	0.15

86	002271	东方雨虹	6,000	331,920.00	0.15
87	601390	中国中铁	62,300	326,452.00	0.15
88	603160	汇顶科技	2,500	324,075.00	0.14
89	000786	北新建材	8,200	321,850.00	0.14
90	002027	分众传媒	33,500	315,235.00	0.14
91	000728	国元证券	39,400	314,018.00	0.14
92	688008	澜起科技	5,000	311,900.00	0.14
93	000708	中信特钢	14,900	310,516.00	0.14
94	300347	泰格医药	1,600	309,280.00	0.14
95	002179	中航光电	3,900	308,178.00	0.14
96	600183	生益科技	12,700	297,307.00	0.13
97	002202	金风科技	24,300	295,488.00	0.13
98	601899	紫金矿业	30,000	290,700.00	0.13
99	002673	西部证券	35,000	288,750.00	0.13
100	300144	宋城演艺	17,100	287,280.00	0.13
101	002601	龙鳞佰利	8,300	287,014.00	0.13
102	601229	上海银行	34,900	286,180.00	0.13
103	002049	紫光国微	1,800	277,542.00	0.12
104	002371	北方华创	1,000	277,380.00	0.12
105	601766	中国中车	45,300	275,424.00	0.12
106	000895	双汇发展	8,519	270,904.20	0.12
107	600741	华域汽车	10,100	265,327.00	0.12
108	002001	新和成	9,240	265,003.20	0.12
109	600019	宝钢股份	34,400	262,816.00	0.12
110	601155	新城控股	6,300	262,080.00	0.12
111	600745	闻泰科技	2,700	261,630.00	0.12
112	000768	中航飞机	9,900	260,172.00	0.12
113	000538	云南白药	2,200	254,584.00	0.11
114	601169	北京银行	51,900	252,753.00	0.11
115	600346	恒力石化	9,400	246,656.00	0.11
116	300003	乐普医疗	7,500	240,900.00	0.11

117	603019	中科曙光	8,700	240,207.00	0.11
118	688396	华润微	2,500	227,550.00	0.10
119	002410	广联达	3,300	225,060.00	0.10
120	601088	中国神华	11,500	224,480.00	0.10
121	300601	康泰生物	1,500	223,500.00	0.10
122	601009	南京银行	21,000	220,920.00	0.10
123	000800	一汽解放	20,000	216,400.00	0.10
124	600050	中国联通	49,700	214,704.00	0.10
125	601360	三六零	17,400	212,454.00	0.09
126	601818	光大银行	55,800	210,924.00	0.09
127	601186	中国铁建	28,100	208,783.00	0.09
128	600763	通策医疗	500	205,500.00	0.09
129	601989	中国重工	48,800	201,056.00	0.09
130	000876	新希望	13,700	200,979.00	0.09
131	300408	三环集团	4,500	190,890.00	0.09
132	001979	招商蛇口	17,100	187,245.00	0.08
133	300122	智飞生物	1,000	186,730.00	0.08
134	601628	中国人寿	5,500	186,395.00	0.08
135	601006	大秦铁路	28,300	186,214.00	0.08
136	000860	顺鑫农业	4,300	181,374.00	0.08
137	601669	中国电建	46,800	181,116.00	0.08
138	600848	上海临港	10,080	180,432.00	0.08
139	601377	兴业证券	18,000	173,880.00	0.08
140	002414	高德红外	6,300	173,754.00	0.08
141	600111	北方稀土	8,100	167,670.00	0.07
142	601877	正泰电器	5,000	166,900.00	0.07
143	300136	信维通信	5,400	166,752.00	0.07
144	601225	陕西煤业	13,900	164,715.00	0.07
145	600383	金地集团	16,000	163,840.00	0.07
146	000069	华侨城 A	22,000	163,680.00	0.07
147	600352	浙江龙盛	11,900	163,506.00	0.07

148	600660	福耀玻璃	2,900	161,965.00	0.07
149	300433	蓝思科技	5,500	161,755.00	0.07
150	601012	隆基股份	1,820	161,688.80	0.07
151	600837	海通证券	14,000	161,000.00	0.07
152	300628	亿联网络	1,900	159,220.00	0.07
153	002236	大华股份	7,500	158,250.00	0.07
154	300413	芒果超媒	2,300	157,780.00	0.07
155	300529	健帆生物	1,800	155,448.00	0.07
156	002607	中公教育	7,400	154,586.00	0.07
157	600926	杭州银行	10,400	153,400.00	0.07
158	002024	苏宁易购	27,300	152,607.00	0.07
159	601607	上海医药	7,200	152,136.00	0.07
160	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.07
161	002044	美年健康	16,400	149,404.00	0.07
162	002821	凯莱英	400	149,040.00	0.07
163	000938	紫光股份	6,800	148,784.00	0.07
164	601985	中国核电	29,200	147,752.00	0.07
165	002008	大族激光	3,600	145,404.00	0.06
166	002142	宁波银行	3,700	144,189.00	0.06
167	603833	欧派家居	1,000	141,960.00	0.06
168	600309	万华化学	1,300	141,466.00	0.06
169	600606	绿地控股	25,900	141,155.00	0.06
170	601800	中国交建	21,600	139,968.00	0.06
171	600085	同仁堂	3,400	138,890.00	0.06
172	600010	包钢股份	88,100	136,555.00	0.06
173	603993	洛阳钼业	26,200	135,192.00	0.06
174	000977	浪潮信息	4,800	135,024.00	0.06
175	600436	片仔癀	300	134,490.00	0.06
176	002120	韵达股份	9,900	133,947.00	0.06
177	600015	华夏银行	21,600	133,704.00	0.06
178	688012	中微公司	800	132,736.00	0.06

179	601138	工业富联	10,600	131,546.00	0.06
180	603939	益丰药房	2,340	131,250.60	0.06
181	600522	中天科技	13,100	131,000.00	0.06
182	601618	中国中冶	43,700	130,226.00	0.06
183	601901	方正证券	13,800	129,168.00	0.06
184	601600	中国铝业	24,300	128,790.00	0.06
185	002945	华林证券	9,200	127,144.00	0.06
186	600029	南方航空	21,000	126,420.00	0.06
187	601336	新华保险	2,700	123,957.00	0.06
188	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.05
189	002252	上海莱士	16,200	121,338.00	0.05
190	000066	中国长城	8,300	121,180.00	0.05
191	601231	环旭电子	7,200	121,032.00	0.05
192	600332	白云山	3,500	118,475.00	0.05
193	601788	光大证券	6,500	116,285.00	0.05
194	600438	通威股份	2,600	112,502.00	0.05
195	600893	航发动力	2,100	111,699.00	0.05
196	601111	中国国航	14,200	110,476.00	0.05
197	603233	大参林	2,160	110,397.60	0.05
198	002600	领益智造	11,800	108,442.00	0.05
199	002384	东山精密	5,000	104,200.00	0.05
200	601990	南京证券	9,900	104,148.00	0.05
201	002938	鹏鼎控股	2,900	104,052.00	0.05
202	600109	国金证券	8,100	102,789.00	0.05
203	603195	公牛集团	500	101,000.00	0.05
204	601066	中信建投	3,200	100,576.00	0.04
205	000656	金科股份	17,200	99,588.00	0.04
206	002555	三七互娱	4,100	98,482.00	0.04
207	600795	国电电力	40,500	98,415.00	0.04
208	600406	国电南瑞	4,200	97,608.00	0.04
209	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.04

210	601021	春秋航空	1,700	96,730.00	0.04
211	601838	成都银行	7,600	96,064.00	0.04
212	300676	华大基因	800	94,880.00	0.04
213	601933	永辉超市	19,900	94,127.00	0.04
214	600655	豫园股份	8,100	93,879.00	0.04
215	600886	国投电力	9,600	92,256.00	0.04
216	000963	华东医药	2,000	92,020.00	0.04
217	002157	正邦科技	7,700	92,015.00	0.04
218	600118	中国卫星	3,100	90,706.00	0.04
219	002916	深南电路	800	88,904.00	0.04
220	600016	民生银行	20,000	88,200.00	0.04
221	601108	财通证券	8,400	88,116.00	0.04
222	601555	东吴证券	10,400	86,736.00	0.04
223	600196	复星医药	1,200	86,556.00	0.04
224	600362	江西铜业	3,800	85,044.00	0.04
225	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.04
226	300059	东方财富	2,520	82,630.80	0.04
227	002456	欧菲光	9,000	79,920.00	0.04
228	601878	浙商证券	6,100	79,788.00	0.04
229	300033	同花顺	700	78,946.00	0.04
230	002463	沪电股份	5,100	78,897.00	0.04
231	603658	安图生物	1,040	78,800.80	0.04
232	600018	上港集团	16,500	78,705.00	0.04
233	601216	君正集团	15,400	78,386.00	0.04
234	002602	世纪华通	12,100	77,682.00	0.03
235	601238	广汽集团	5,900	76,405.00	0.03
236	601727	上海电气	17,100	72,504.00	0.03
237	600061	国投资本	8,512	72,266.88	0.03
238	600705	中航资本	18,000	69,660.00	0.03
239	600600	青岛啤酒	600	69,390.00	0.03
240	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03

241	600011	华能国际	15,100	63,722.00	0.03
242	600489	中金黄金	7,200	62,064.00	0.03
243	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.03
244	600233	圆通速递	6,000	60,060.00	0.03
245	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.03
246	603899	晨光文具	700	59,192.00	0.03
247	600760	中航沈飞	980	59,094.00	0.03
248	601658	邮储银行	11,700	58,734.00	0.03
249	600176	中国巨石	3,772	58,503.72	0.03
250	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.03
251	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
252	300979	华利集团	638	55,825.00	0.02
253	601998	中信银行	10,800	55,080.00	0.02
254	688009	中国通号	9,600	54,624.00	0.02
255	601162	天风证券	11,200	54,432.00	0.02
256	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
257	601872	招商轮船	11,520	53,222.40	0.02
258	600845	宝信软件	1,040	52,936.00	0.02
259	600482	中国动力	3,000	52,260.00	0.02
260	002773	康弘药业	2,200	50,886.00	0.02
261	002153	石基信息	2,100	49,371.00	0.02
262	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
263	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.02
264	002812	恩捷股份	200	46,820.00	0.02
265	601916	浙商银行	11,700	46,449.00	0.02
266	601881	中国银河	4,300	46,354.00	0.02
267	603986	兆易创新	240	45,096.00	0.02
268	600809	山西汾酒	100	44,800.00	0.02
269	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
270	600161	天坛生物	1,300	44,525.00	0.02
271	002739	万达电影	2,800	44,212.00	0.02

272	601100	恒立液压	500	42,960.00	0.02
273	601319	中国人保	7,200	42,696.00	0.02
274	300973	立高食品	360	41,655.60	0.02
275	600150	中国船舶	2,500	41,275.00	0.02
276	600872	中炬高新	900	37,818.00	0.02
277	601808	中海油服	2,600	37,336.00	0.02
278	601698	中国卫通	2,300	37,237.00	0.02
279	603392	万泰生物	140	36,285.20	0.02
280	600025	华能水电	6,200	35,898.00	0.02
281	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
282	002558	巨人网络	2,600	34,580.00	0.02
283	002032	苏泊尔	500	31,895.00	0.01
284	601888	中国中免	100	30,010.00	0.01
285	600031	三一重工	1,000	29,070.00	0.01
286	600918	中泰证券	2,600	28,132.00	0.01
287	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
288	000625	长安汽车	1,000	26,280.00	0.01
289	002594	比亚迪	100	25,100.00	0.01
290	601077	渝农商行	6,200	24,738.00	0.01
291	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
292	000596	古井贡酒	100	23,950.00	0.01
293	000568	泸州老窖	100	23,594.00	0.01
294	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
295	002304	洋河股份	100	20,720.00	0.01
296	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
297	603259	药明康德	120	18,790.80	0.01
298	601696	中银证券	900	18,531.00	0.01
299	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
300	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
301	603288	海天味业	130	16,763.50	0.01
302	600299	安迪苏	1,300	15,548.00	0.01

303	600989	宝丰能源	1,100	15,048.00	0.01
304	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
305	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.01
306	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
307	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
308	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
309	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
310	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
311	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
312	603171	N税友	637	12,230.40	0.01
313	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.01
314	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
315	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
316	603799	华友钴业	100	11,420.00	0.01
317	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
318	002007	华兰生物	300	11,004.00	0.00
319	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
320	603087	甘李药业	100	10,658.00	0.00
321	300014	亿纬锂能	100	10,393.00	0.00
322	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
323	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
324	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
325	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
326	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
327	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
328	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
329	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
330	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
331	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
332	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
333	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00

334	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
335	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
336	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
337	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
338	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
339	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
340	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
341	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
342	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
343	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
344	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
345	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
346	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
347	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
348	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
349	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
350	603369	今世缘	100	5,416.00	0.00
351	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
352	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
353	605011	N杭热	525	4,662.00	0.00
354	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
355	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
356	601633	长城汽车	100	4,359.00	0.00
357	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
358	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
359	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
360	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
361	601236	红塔证券	100	1,356.00	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	600030	中信证券	12,033,487.00	5.51
2	000776	广发证券	11,492,434.00	5.26
3	601398	工商银行	7,614,734.00	3.49
4	601816	京沪高铁	6,510,981.23	2.98
5	002475	立讯精密	6,166,181.00	2.82
6	000002	万科A	5,888,165.00	2.70
7	000651	格力电器	5,886,912.00	2.70
8	003816	中国广核	5,863,643.00	2.69
9	002352	顺丰控股	5,253,555.00	2.41
10	600028	中国石化	5,183,200.00	2.37
11	601688	华泰证券	4,698,801.00	2.15
12	601939	建设银行	4,307,198.00	1.97
13	601288	农业银行	4,301,410.00	1.97
14	601318	中国平安	4,139,228.00	1.90
15	000166	申万宏源	4,010,500.00	1.84
16	000783	长江证券	4,007,047.00	1.83
17	600036	招商银行	3,662,663.00	1.68
18	601995	中金公司	3,330,063.76	1.52
19	000333	美的集团	3,315,963.96	1.52
20	601857	中国石油	3,237,817.00	1.48

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	000776	广发证券	12,272,665.92	5.62
2	600030	中信证券	10,556,755.00	4.83

3	600519	贵州茅台	6,680,775.00	3.06
4	003816	中国广核	6,001,698.00	2.75
5	601816	京沪高铁	5,906,821.00	2.70
6	601398	工商银行	5,903,708.00	2.70
7	000858	五粮液	5,315,047.00	2.43
8	000001	平安银行	5,309,242.00	2.43
9	600036	招商银行	4,954,221.00	2.27
10	000166	申万宏源	4,898,686.47	2.24
11	000783	长江证券	4,502,470.00	2.06
12	601939	建设银行	3,974,121.00	1.82
13	601688	华泰证券	3,834,073.00	1.76
14	600028	中国石化	3,568,996.00	1.63
15	600690	海尔智家	3,490,905.50	1.60
16	002142	宁波银行	3,324,712.00	1.52
17	601211	国泰君安	3,158,146.00	1.45
18	002352	顺丰控股	3,145,201.00	1.44
19	000333	美的集团	2,835,779.00	1.30
20	002460	赣锋锂业	2,726,457.96	1.25

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	182,311,079.29
卖出股票收入（成交）总额	214,026,388.87

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

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	99,027,468.00	44.22

2	央行票据	-	-
3	金融债券	22,321,200.00	9.97
	其中：政策性金融债	22,321,200.00	9.97
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	15,008,000.00	6.70
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	30,155,060.40	13.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	166,511,728.40	74.35

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	019645	20国债15	762,800	76,516,468.00	34.17
2	019640	20国债10	225,110	22,511,000.00	10.05
3	132009	17中油EB	170,000	17,493,000.00	7.81
4	132007	16凤凰EB	120,060	12,527,060.40	5.59
5	018008	国开1802	120,000	12,283,200.00	5.48

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	102,672.36
2	应收证券清算款	5,868,169.38
3	应收股利	-
4	应收利息	2,578,980.56
5	应收申购款	60,852.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	8,610,675.27
---	----	--------------

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
2,292	58,872.17	77,822,295.47	57.67%	57,112,710.76	42.33%

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	0.00	0.00%

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年06月29日)基金份额总额	952,004,756.57
本报告期期初基金份额总额	140,030,657.54
本报告期基金总申购份额	136,397,393.27
减:本报告期基金总赎回份额	141,493,044.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	134,935,006.23

§ 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,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门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、托管人及其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	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	佣金	占当期佣金总量的比	

	数量		的比例		例	
财通证券	1	92,173,762.86	23.74%	85,841.54	24.14%	-
德邦证券	1	129,275,051.34	33.30%	117,808.69	33.12%	-
东北证券	1	9,906,386.16	2.55%	7,046.35	1.98%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	21,403,235.31	5.51%	19,505.24	5.49%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	47,630,306.42	12.27%	44,358.17	12.47%	-
国盛证券	3	87,870,251.65	22.63%	81,107.14	22.80%	-

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：退租广发证券交易单元1个、新增粤开证券交易单元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
财通证券	283,500,991.85	40.01%	2,458,100,000.00	53.13%	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	77,817.45	0.01%	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

粤开证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	129,460,93 6.65	18.2 7%	312,500,00 0.00	6.75%	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证 券	208,077,60 9.53	29.3 7%	1,177,000,0 00.00	25.4 4%	-	-	-	-
国盛证 券	87,409,48 4.86	12.3 4%	679,000,00 0.00	14.6 8%	-	-	-	-

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	天治旗下十四只基金2020年 第4季度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、 证券日报	2021-01-22
2	天治财富增长证券投资基金 暂停大额申购、转换转入、 定期定额投资业务的公告	上证报	2021-02-10
3	天治基金管理有限公司关于 调整旗下部分基金在盈米基 金最低申购金额、最低赎回、 转换、持有份额的公告	上证报、中证报、证券时报	2021-02-23
4	天治基金管理有限公司旗下 基金增加汇成基金为代销机 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	上证报、中证报、证券时报、 证券日报	2021-03-04

5	天治财富增长证券投资基金调整大额申购、转换转入、定期定额投资限额的公告	上证报	2021-03-23
6	天治旗下十四只基金2020年年度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-03-30
7	天治财富增长证券投资基金基金经理变更公告	上证报	2021-04-15
8	天治财富增长证券投资基金更新的招募说明书、天治财富增长证券投资基金基金产品资料概要更新	上证报	2021-04-16
9	天治旗下十四只基金2021年第1季度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-04-21
10	天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加吉林银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-05-28
11	天治基金管理有限公司关于天治财富增长证券投资基金在直销中心开展赎回费率优惠活动的公告	上证报	2021-06-02
12	天治基金管理有限公司旗下基金增加中信期货、中信证券华南为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-06-11
13	天治基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加上海基煜基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-06-24
14	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加爱建基金为代销机构、开通基金转换业务	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-06-24

	并参加费率优惠活动的公告		
15	天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-06-30

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20210101-20210223;20210604-20210621	35,686,861.38	0.00	20,686,861.38	15,000,000.00	11.12%
产品特有风险							
本基金报告期内有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，存在持有人一次性赎回带来的流动性风险。根据份额持有人的结构和特点，本基金的投资组合已经根据其可能产生的流动性风险做出相应调整，减少流动性不佳资产的配置，增加流动性较好资产的配置，目前组合中流动性较好的资产比例较高，20%以上份额持有人一次性赎回对本基金的流动性影响有限。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

经天治基金管理有限公司总经理办公会决定，自2021年4月15日起，增聘李申先生担任本基金基金经理职务。上述事项已按有关规定在中国证券投资基金业协会完成相关手续，并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案，本基金管理人于2021年4月15日在指定媒体及公司网站上刊登了相关公告。

§ 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财富增长证券投资基金设立的文件
2. 《天治财富增长证券投资基金基金合同》
3. 《天治财富增长证券投资基金托管协议》
4. 《天治财富增长证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内天治财富增长证券投资基金公告的各项原稿

12.2 存放地点

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
二〇二一年八月二十七日