

天治新消费灵活配置混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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:上海银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月25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。

本基金由天治成长精选混合型证券投资基金于2016年7月6日通过转型变更而来。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§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 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天治新消费灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	天治新消费混合
基金主代码	350008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年07月06日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,990,089.95份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在灵活配置股票和债券资产的基础上，精选受益于新消费主题的相关企业，追求持续稳健的超额回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采用"大类资产比较研究"的分析视角，在综合考量中国宏观经济运行态势、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素的基础上，综合评价各类资产的风险收益水平，进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，并采取动态调整策略。在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例；在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，同时采取金融衍生产品对冲下行风险，控制基金净值回撤幅度，力求实现基金财产的长期稳定增值，提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>经济社会发展主要任务之一是加快培育新的消费增长点，大力促进养老家政健康、信息、旅游休闲、绿色、教育文化体育等领域消费。在基本上，刺激</p>

	消费增长是政府发展经济的重要手段和目标，新兴消费在中长期将迎来发展机遇。
业绩比较基准	申银万国消费品指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

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	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵正中	周直毅
	联系电话	021-60371155	021-68475608
	电子邮箱	zhaozz@chinanature.com.cn	custody@bosc.cn
客户服务电话		400-098-4800（免长途通话费用）、021-60374800	95594
传真		021-60374934	021-68476901
注册地址		上海市徐汇区丰谷路315弄24号1-3层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号
办公地址		上海市复兴西路159号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号27层
邮政编码		200031	200120
法定代表人		马铁刚	金煜

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 (2023年01月01日- 2023年06月30日)	
	本期已实现收益	330,685.26
本期利润	-435,374.35	
加权平均基金份额本期利润	-0.0529	
本期加权平均净值利润率	-3.31%	
本期基金份额净值增长率	-3.42%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
	期末可供分配利润	3,515,377.48
	期末可供分配基金份额利润	0.4400
	期末基金资产净值	11,505,467.43
	期末基金份额净值	1.440
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	-15.54%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	-2.37%	1.24%	0.76%	0.41%	-3.13%	0.83%
过去三个月	-13.57%	1.02%	-2.47%	0.37%	-11.10%	0.65%
过去六个月	-3.42%	1.08%	-0.01%	0.42%	-3.41%	0.66%
过去一年	-22.79%	1.24%	-4.16%	0.51%	-18.63%	0.73%
过去三年	-24.25%	1.38%	2.99%	0.66%	-27.24%	0.72%
自基金合同生效起至今	-15.54%	1.32%	36.87%	0.64%	-52.41%	0.68%

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

天治新消费灵活配置混合型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

(2016年07月06日-2023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2023年6月30日，本基金管理人旗下共有十四只开放式基金，除本基金外，另外十三只基金--天治财富增长证券投资基金、天治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）、天治鑫利纯债债券型证券投资基金（转型自2016年12月7日生效的天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金）、天治转型升级混合型证券投资基金、天治量化核心精选混合型证券投资基金、天治天享66个月定期开放债券型证券投资基金分别于2004年6月29日、2006年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、2019年3月7日、2019年5月21日、2019年6月11日、2021年09月16日生效。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁莉	研究发展部副总监、本基金基金经理、天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2022-01-18	-	12年	硕士研究生，具有基金从业资格。2011年5月至2015年6月于东北证券上海研究咨询分公司任研究员。2015年7月加入天治基金管理有限公司，曾任研究发

					展部研究员、专户投资部 投资经理。
--	--	--	--	--	----------------------

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

国内经济疫后显著修复后再回落、美债利率下行、海外经济好于预期是影响上半年全球大类资产的重要因素。受海外通胀压力边际缓解、美联储加息处于尾声和人工智能产业浪潮催化，上半年全球股市普遍上涨，其中纳斯达克指数和日经225指数涨幅居前，国内上证指数小幅上涨，创业板指数和沪深300指数下跌。从市场风格来看，国内成长风格占优，海外人工智能相关板块涨幅显著。上半年商品市场普遍下跌，原油和农产品跌幅相对较大，工业金属跌幅较小，贵金属上涨。美联储加息处于尾声阶段，美债利率上半年高位震荡，国内经济低于预期，国债利率显著下行。

上半年国内经济经历了疫情结束显著修复后再回落，一季度在疫情消退、需求回补和稳增长政策发力情形下，制造业PMI持续位于荣枯线以上，扭转了2022年四季度低迷的趋势。年初央行和银监会强调“合理把握信贷投放节奏，适度靠前发力”，叠加地方政府稳增长动力较强，一季度新增社融和信贷总体较好。总体来看，一季度国内经济呈现弱复苏的状态，服务业修复好于生产，地产由于疫后需求回补的因素销量增速显著收窄，竣工大幅修复但拿地和开工仍然较弱，一季度经济好于预期的情形下，市场对政策刺激的预期有所降温，两会《政府工作报告》将2023年增速目标定在5%左右，体现了高质量发展的诉求。二季度国内经济内生修复动力不足，高频数据修复斜率放缓，4月出口环比增速处于历史偏低水平，显示积压订单释放后出口动能减弱，东南亚等一带一路国家对我国出口支撑作用较强，机电产品和汽车出口维持较高的景气度。4月制造业PMI跌破荣枯线，二季度持续位于50以下，同时4月新增社融和信贷数据也低于市场预期，信贷节奏前置和银行季末冲量也透支了部分项目储备，另一方面，控制信贷节奏、内生需求偏弱也是4月新增信贷、社融低于预期的主要因素。6月国内高频数据呈现趋稳迹象，同时6月制造业PMI相对5月小幅回升，上半年工业企业产成品库存持续下降，PPI同比接近底部。国常会指出我国经济发展基础尚不稳固，要提振发展预期，分批次推出含金量高的政策，并且央行二季度透露出稳增长的积极信号，加大逆周期调节并防范汇率大起大落。

上半年，本基金重点围绕大消费领域中疫后消费复苏板块，如白酒、医药、家电、家居等板块做重点布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末天治新消费混合基金份额净值为1.440元，本报告期内，基金份额净值增长率为-3.42%，同期业绩比较基准收益率为-0.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着国内库存周期触底和稳增长政策落地，国内经济最差的时点已经过去。海外加息周期接近尾声叠加国内经济逐步改善，人民币汇率有望回归到合理的水

平。预计下半年PPI同比将逐步回升，企业盈利总体将处于修复趋势，同时国常会和央行货币政策例会也透露出政策的积极信号。

下半年，国内经济将企稳回升，虽然向上修复的斜率尚待观察，但是，消费向上逐步修复的方向是明朗的。本基金将继续重点围绕大消费板块中经济复苏相关的板块，如食品、医药、家电、家居、出行链、消费电子等做重点布局。本基金将严格对市场中的各项风险做好评估和控制，通过精选行业和个股，并不断动态调整组合的风险收益比来获取超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，该情况自2016年7月6日起出现。基金管理人已向监管部门报告并提出解决方案。

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天治新消费灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	721,847.99	1,191,006.24
结算备付金		43,498.69	84,508.43
存出保证金		42,511.24	26,453.37
交易性金融资产	6.4.7.2	10,814,174.70	11,445,935.00
其中：股票投资		10,814,174.70	11,445,935.00
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		90,881.46	-
应收股利		-	-
应收申购款		925.62	15,128.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		11,713,839.70	12,763,031.36
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		89,626.34	444,473.03
应付赎回款		-	395.49
应付管理人报酬		14,730.05	15,169.87
应付托管费		2,455.01	2,528.30
应付销售服务费		-	-

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	101,560.87	125,088.33
负债合计		208,372.27	587,655.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	7,990,089.95	8,163,983.22
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	3,515,377.48	4,011,393.12
净资产合计		11,505,467.43	12,175,376.34
负债和净资产总计		11,713,839.70	12,763,031.36

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.440元，基金份额总额7,990,089.95份。

6.2 利润表

会计主体：天治新消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		-299,686.13	-2,449,406.95
1.利息收入		11,024.80	16,339.34
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,024.80	13,468.79
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		-	2,870.55
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”		452,747.47	-2,116,032.91

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.10	388,484.40	-2,145,805.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	19,633.42
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	64,263.07	10,139.64
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	-766,059.61	-349,889.60
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	2,601.21	176.22
减：二、营业总支出		135,688.22	100,814.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	97,835.61	67,980.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	16,305.92	11,330.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	0.07
8. 其他费用	6.4.7.19	21,546.69	21,503.69
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-435,374.35	-2,550,221.84

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-435,374.35	-2,550,221.84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-435,374.35	-2,550,221.84

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天治新消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	8,163,983.22	-	4,011,393.12	12,175,376.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	8,163,983.22	-	4,011,393.12	12,175,376.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-173,893.27	-	-496,015.64	-669,908.91
（一）、综合收益总额	-	-	-435,374.35	-435,374.35
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值	-173,893.27	-	-60,641.29	-234,534.56

变动数(净值减少以“-”号填列)				
其中: 1.基金申购款	1,245,680.58	-	802,026.40	2,047,706.98
2.基金赎回款	-1,419,573.85	-	-862,667.69	-2,282,241.54
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	7,990,089.95	-	3,515,377.48	11,505,467.43
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	4,767,975.29	-	6,686,199.94	11,454,175.23
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	4,767,975.29	-	6,686,199.94	11,454,175.23

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-197,729.82	-	-2,733,775.62	-2,931,505.44
（一）、综合收益总额	-	-	-2,550,221.84	-2,550,221.84
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-197,729.82	-	-183,553.78	-381,283.60
其中：1.基金申购款	151,144.58	-	153,450.65	304,595.23
2.基金赎回款	-348,874.40	-	-337,004.43	-685,878.83
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	4,570,245.47	-	3,952,424.32	8,522,669.79

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：

马铁刚

马铁刚

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

天治新消费灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系由天治成长精选混合型证券投资基金转型而来，天治成长精选混合型证券投资基金（原名天治成长精选股票型证券投资基金）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]737号文《关于核准天治成长精选股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人天治基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2011年8月4日正式生效，首次设立募集规模为524,890,436.66份基金份额。鉴于《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》的相关要求，经与基金托管人上海银行股份有限公司协商一致，自2015年8月4日起本基金更名为天治成长精选混合型证券投资基金。根据《天治基金管理有限公司关于天治成长精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》及《天治基金管理有限公司关于天治成长精选混合型证券投资基金名称变更的公告》，基金份额持有人大会于2016年7月6日表决通过了《关于天治成长精选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。自该日起，天治成长精选混合型证券投资基金正式更名为天治新消费灵活配置混合型证券投资基金，其投资目标、投资范围、投资策略、收益分配方式等内容进行相应修订，原《天治成长精选混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。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，基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、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）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金股票及存托凭证资产投资比例为基金资产的0%-95%，其中，投资于受益于新消费主题相关企业的证券不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：申银万国消费品指数收益率×50%+中证全债指数收益率×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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年6月30日的财务状况以及2023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、会计估值与2022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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《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 2023年06月30日
活期存款	721,847.99
等于：本金	721,711.29
加：应计利息	136.70
减：坏账准备	-
定期存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	721,847.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	11,476,735.31	-	10,814,174.70	-662,560.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	11,476,735.31	-	10,814,174.70	-662,560.61

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 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	46,343.38
其中：交易所市场	46,343.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	37,396.69
其他应付	17,820.80
合计	101,560.87

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,163,983.22	8,163,983.22
本期申购	1,245,680.58	1,245,680.58
本期赎回（以“-”号填列）	-1,419,573.85	-1,419,573.85

本期末	7,990,089.95	7,990,089.95
-----	--------------	--------------

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	10,342,590.37	-6,331,197.25	4,011,393.12
本期利润	330,685.26	-766,059.61	-435,374.35
本期基金份额交易产生的变动数	-247,838.52	187,197.23	-60,641.29
其中：基金申购款	1,781,272.58	-979,246.18	802,026.40
基金赎回款	-2,029,111.10	1,166,443.41	-862,667.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,425,437.11	-6,910,059.63	3,515,377.48

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	10,006.78
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	705.20
其他	312.82
合计	11,024.80

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	63,405,550.31
减：卖出股票成本总额	62,826,624.59

减：交易费用	190,441.32
买卖股票差价收入	388,484.40

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益--买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益--赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益--申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益--赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益--申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	64,263.07
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	64,263.07

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-766,059.61
——股票投资	-766,059.61
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-766,059.61

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	1,494.52
基金转换费收入	1,106.69
合计	2,601.21

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	12,396.69
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	150.00
账户维护费	9,000.00
合计	21,546.69

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

注：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

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 2023年01月01日至202 3年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	97,835.61	67,980.93
其中：支付销售机构的客户维护费	20,036.87	21,756.64

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：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，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 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,305.92	11,330.20

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：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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
上海银行股份有限公司	721,847.99	10,006.78	7,270,345.35	12,525.61

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023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**

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2023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金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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 2023 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	721,847.99	-	-	-	-	-	721,847.99
结算备付金	43,498.69	-	-	-	-	-	43,498.69
存出保证金	42,511.24	-	-	-	-	-	42,511.24
交易性金融资产	-	-	-	-	-	10,814,174.70	10,814,174.70
应收清算款	-	-	-	-	-	90,881.46	90,881.46
应收申购款	-	-	-	-	-	925.62	925.62
资产总计	807,857.92	-	-	-	-	10,905,981.78	11,713,839.70
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	89,626.34	89,626.34
应付管理人报	-	-	-	-	-	14,730.05	14,730.05

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	2,455.01	2,455.01
其他负债	-	-	-	-	-	101,560.87	101,560.87
负债总计	-	-	-	-	-	208,372.27	208,372.27
利率敏感度缺口	807,857.92	-	-	-	-	10,697,609.51	11,505,467.43
上年度末 2022年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,191,006.24	-	-	-	-	-	1,191,006.24
结算备付金	84,508.43	-	-	-	-	-	84,508.43
存出保证金	26,453.37	-	-	-	-	-	26,453.37
交易性金融资产	-	-	-	-	-	11,445,935.00	11,445,935.00
应收申购款	-	-	-	-	-	15,128.32	15,128.32
资产总计	1,301,968.04	-	-	-	-	11,461,063.32	12,763,031.36
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	444,473.03	444,473.03
应付赎回款	-	-	-	-	-	395.49	395.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	15,169.87	15,169.87
应付托管费	-	-	-	-	-	2,528.30	2,528.30
其他负债	-	-	-	-	-	125,088.33	125,088.33
负债总计	-	-	-	-	-	587,655.02	587,655.02
利率敏感度缺口	1,301,968.04	-	-	-	-	10,873,408.30	12,175,376.34

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

本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债及可交换债），且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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 2023年06月30日		上年度末 2022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	10,814,174.70	93.99	11,445,935.00	94.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	10,814,174.70	93.99	11,445,935.00	94.01
----	---------------	-------	---------------	-------

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	942,372.71	804,662.50
	业绩比较基准变动-5%	-942,372.71	-804,662.50

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	10,814,174.70	11,445,935.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	10,814,174.70	11,445,935.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,814,174.70	92.32
	其中：股票	10,814,174.70	92.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	765,346.68	6.53

8	其他各项资产	134,318.32	1.15
9	合计	11,713,839.70	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	-	-
C	制造业	8,220,746.10	71.45
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,399,352.60	12.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	110,530.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	516,517.00	4.49
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	206,894.00	1.80
Q	卫生和社会工作	360,135.00	3.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,814,174.70	93.99

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	000858	五粮液	5,200	850,564.00	7.39
2	002304	洋河股份	6,300	827,505.00	7.19
3	600809	山西汾酒	4,300	795,801.00	6.92
4	000568	泸州老窖	2,500	523,925.00	4.55
5	600276	恒瑞医药	9,100	435,890.00	3.79
6	603259	药明康德	5,700	355,167.00	3.09
7	688018	乐鑫科技	2,600	337,532.00	2.93
8	688099	晶晨股份	3,900	328,848.00	2.86
9	688608	恒玄科技	2,700	326,781.00	2.84
10	688050	爱博医疗	1,500	307,995.00	2.68
11	603893	瑞芯微	4,100	298,685.00	2.60
12	688766	普冉股份	2,735	292,152.70	2.54
13	688110	东芯股份	7,800	281,580.00	2.45
14	688373	盟科药业	31,600	270,180.00	2.35
15	688008	澜起科技	4,700	269,874.00	2.35
16	300458	全志科技	9,600	261,600.00	2.27
17	688029	南微医学	3,200	260,992.00	2.27
18	603986	兆易创新	2,400	255,000.00	2.22
19	300223	北京君正	2,700	238,437.00	2.07
20	688123	聚辰股份	4,370	234,756.40	2.04
21	002821	凯莱英	1,900	223,934.00	1.95
22	002929	润建股份	4,800	208,368.00	1.81
23	300015	爱尔眼科	11,200	207,760.00	1.81
24	003032	传智教育	14,200	206,894.00	1.80
25	300896	爱美客	400	177,980.00	1.55
26	600519	贵州茅台	100	169,100.00	1.47

27	300347	泰格医药	2,500	161,350.00	1.40
28	603501	韦尔股份	1,600	156,864.00	1.36
29	301267	华夏眼科	2,500	152,375.00	1.32
30	688798	艾为电子	2,500	147,875.00	1.29
31	688045	必易微	2,500	142,500.00	1.24
32	688052	纳芯微	880	139,365.60	1.21
33	688515	裕太微	800	137,328.00	1.19
34	688088	虹软科技	3,000	128,250.00	1.11
35	300595	欧普康视	4,000	120,760.00	1.05
36	688368	晶丰明源	900	114,489.00	1.00
37	601888	中国中免	1,000	110,530.00	0.96
38	603208	江山欧派	2,600	94,692.00	0.82
39	002572	索菲亚	4,000	69,680.00	0.61
40	603816	顾家家居	1,800	68,670.00	0.60
41	002508	老板电器	2,500	63,225.00	0.55
42	000333	美的集团	1,000	58,920.00	0.51

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	000858	五粮液	2,931,823.00	24.08
2	002304	洋河股份	2,541,643.00	20.88
3	600809	山西汾酒	2,389,150.00	19.62
4	000568	泸州老窖	2,349,412.00	19.30
5	600519	贵州茅台	2,135,754.00	17.54
6	600276	恒瑞医药	1,476,599.00	12.13
7	688373	盟科药业	1,467,588.55	12.05
8	002508	老板电器	1,284,725.00	10.55
9	603816	顾家家居	1,193,193.00	9.80

10	300347	泰格医药	1,171,294.00	9.62
11	002821	凯莱英	1,158,885.00	9.52
12	300595	欧普康视	1,134,086.00	9.31
13	300015	爱尔眼科	1,114,866.78	9.16
14	603259	药明康德	1,051,051.00	8.63
15	688266	泽璟制药	1,043,620.48	8.57
16	600779	水井坊	1,031,613.28	8.47
17	000739	普洛药业	964,524.00	7.92
18	688366	昊海生科	902,003.41	7.41
19	600690	海尔智家	854,987.00	7.02
20	603589	口子窖	829,690.00	6.81
21	601888	中国中免	828,067.00	6.80
22	000333	美的集团	801,818.17	6.59
23	603288	海天味业	795,050.00	6.53
24	688029	南微医学	741,499.26	6.09
25	300896	爱美客	731,300.00	6.01
26	300759	康龙化成	703,281.00	5.78
27	600132	重庆啤酒	675,255.00	5.55
28	002572	索菲亚	666,476.00	5.47
29	688677	海泰新光	634,974.56	5.22
30	603833	欧派家居	633,868.00	5.21
31	000799	酒鬼酒	623,828.00	5.12
32	600702	舍得酒业	621,519.00	5.10
33	002035	华帝股份	594,601.00	4.88
34	301267	华夏眼科	581,796.00	4.78
35	688315	诺禾致源	566,770.80	4.66
36	600515	海南机场	565,040.00	4.64
37	000516	国际医学	554,056.00	4.55
38	300957	贝泰妮	552,476.00	4.54
39	000596	古井贡酒	500,293.00	4.11
40	688050	爱博医疗	496,058.28	4.07

41	300122	智飞生物	481,684.00	3.96
42	300760	迈瑞医疗	454,778.00	3.74
43	688208	道通科技	412,335.40	3.39
44	600009	上海机场	411,086.00	3.38
45	688018	乐鑫科技	407,382.64	3.35
46	603208	江山欧派	407,378.00	3.35
47	300451	创业慧康	403,575.00	3.31
48	000661	长春高新	400,874.00	3.29
49	688078	龙软科技	398,180.93	3.27
50	603198	迎驾贡酒	392,771.00	3.23
51	688099	晶晨股份	391,281.07	3.21
52	688008	澜起科技	379,909.18	3.12
53	300212	易华录	376,734.00	3.09
54	603486	科沃斯	376,515.00	3.09
55	688176	亚虹医药	375,913.41	3.09
56	600763	通策医疗	371,748.00	3.05
57	600559	老白干酒	366,384.00	3.01
58	688331	荣昌生物	362,427.07	2.98
59	688608	恒玄科技	360,168.00	2.96
60	600521	华海药业	354,040.02	2.91
61	000538	云南白药	345,081.00	2.83
62	300847	中船汉光	341,455.00	2.80
63	603508	思维列控	341,289.20	2.80
64	603893	瑞芯微	327,624.00	2.69
65	688536	思瑞浦	326,924.73	2.69
66	300634	彩讯股份	325,366.00	2.67
67	002368	太极股份	312,776.00	2.57
68	688601	力芯微	307,479.42	2.53
69	600436	片仔癀	303,881.00	2.50
70	300253	卫宁健康	302,260.00	2.48
71	688045	必易微	302,063.47	2.48

72	688766	普冉股份	297,830.01	2.45
73	002912	中新赛克	295,415.00	2.43
74	603138	海量数据	292,247.00	2.40
75	300458	全志科技	285,964.00	2.35
76	300223	北京君正	282,743.00	2.32
77	688016	心脉医疗	281,754.00	2.31
78	600418	江淮汽车	278,980.00	2.29
79	002602	世纪华通	273,890.00	2.25
80	688110	东芯股份	268,494.26	2.21
81	300725	药石科技	268,216.00	2.20
82	002268	电科网安	264,244.00	2.17
83	000032	深桑达 A	260,614.00	2.14
84	603232	格尔软件	260,068.00	2.14
85	301153	中科江南	256,985.00	2.11
86	688687	凯因科技	255,840.34	2.10
87	301236	软通动力	252,069.00	2.07
88	603986	兆易创新	250,289.00	2.06
89	300454	深信服	248,147.00	2.04
90	688123	聚辰股份	244,735.91	2.01
91	300498	温氏股份	244,035.00	2.00

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	000858	五粮液	2,060,642.00	16.92
2	600519	贵州茅台	1,963,123.00	16.12
3	000568	泸州老窖	1,875,516.00	15.40
4	600276	恒瑞医药	1,733,935.00	14.24

5	002304	洋河股份	1,623,037.00	13.33
6	688373	盟科药业	1,613,912.93	13.26
7	600809	山西汾酒	1,391,913.68	11.43
8	688266	泽璟制药	1,367,111.20	11.23
9	300347	泰格医药	1,285,666.00	10.56
10	002508	老板电器	1,256,000.00	10.32
11	000739	普洛药业	1,200,021.00	9.86
12	603816	顾家家居	1,128,946.00	9.27
13	601888	中国中免	1,081,146.00	8.88
14	300015	爱尔眼科	1,078,102.00	8.85
15	600779	水井坊	988,451.20	8.12
16	688366	昊海生科	945,316.50	7.76
17	603259	药明康德	941,159.00	7.73
18	300595	欧普康视	932,859.00	7.66
19	688029	南微医学	886,599.23	7.28
20	300760	迈瑞医疗	870,692.00	7.15
21	002821	凯莱英	863,640.00	7.09
22	300451	创业慧康	855,752.00	7.03
23	600690	海尔智家	847,404.00	6.96
24	300122	智飞生物	842,683.00	6.92
25	000516	国际医学	821,724.00	6.75
26	603589	口子窖	820,409.00	6.74
27	000333	美的集团	779,573.00	6.40
28	603288	海天味业	770,543.31	6.33
29	688315	诺禾致源	712,403.67	5.85
30	300253	卫宁健康	707,805.00	5.81
31	600763	通策医疗	701,373.00	5.76
32	688677	海泰新光	631,998.81	5.19
33	600515	海南机场	622,160.00	5.11
34	002035	华帝股份	617,050.00	5.07
35	002572	索菲亚	615,603.00	5.06

36	603833	欧派家居	593,180.10	4.87
37	600132	重庆啤酒	588,303.00	4.83
38	300759	康龙化成	587,091.00	4.82
39	600702	舍得酒业	555,865.00	4.57
40	688050	爱博医疗	542,730.08	4.46
41	600536	中国软件	542,033.00	4.45
42	300896	爱美客	539,132.00	4.43
43	300226	上海钢联	535,985.60	4.40
44	000596	古井贡酒	514,681.00	4.23
45	000799	酒鬼酒	500,410.00	4.11
46	002152	广电运通	497,378.00	4.09
47	300957	贝泰妮	493,926.12	4.06
48	688111	金山办公	473,098.00	3.89
49	688015	交控科技	468,270.28	3.85
50	688208	道通科技	459,629.52	3.78
51	688175	高凌信息	444,203.00	3.65
52	688078	龙软科技	428,416.91	3.52
53	603198	迎驾贡酒	426,768.00	3.51
54	300212	易华录	415,285.00	3.41
55	300366	创意信息	413,676.00	3.40
56	600633	浙数文化	410,577.00	3.37
57	600009	上海机场	406,550.00	3.34
58	688579	山大地纬	404,763.58	3.32
59	301267	华夏眼科	401,360.19	3.30
60	002368	太极股份	401,265.00	3.30
61	300847	中船汉光	383,713.00	3.15
62	000034	神州数码	380,018.00	3.12
63	002727	一心堂	374,332.00	3.07
64	300634	彩讯股份	373,292.00	3.07
65	002707	众信旅游	369,820.00	3.04
66	300659	中孚信息	367,783.00	3.02

67	603486	科沃斯	350,338.00	2.88
68	688331	荣昌生物	349,977.50	2.87
69	000538	云南白药	349,871.00	2.87
70	600559	老白干酒	343,374.00	2.82
71	600521	华海药业	341,421.00	2.80
72	603508	思维列控	340,972.00	2.80
73	300925	法本信息	340,734.00	2.80
74	688176	亚虹医药	338,176.13	2.78
75	000661	长春高新	337,643.00	2.77
76	603138	海量数据	331,638.00	2.72
77	600436	片仔癀	315,975.00	2.60
78	688536	思瑞浦	315,685.11	2.59
79	002602	世纪华通	313,527.00	2.58
80	002912	中新赛克	306,347.00	2.52
81	603208	江山欧派	305,659.00	2.51
82	000032	深桑达 A	301,871.00	2.48
83	600418	江淮汽车	292,973.00	2.41
84	688601	力芯微	291,573.87	2.39
85	002268	电科网安	285,575.00	2.35
86	688023	安恒信息	277,661.75	2.28
87	688016	心脉医疗	272,556.88	2.24
88	301236	软通动力	268,753.00	2.21
89	603232	格尔软件	267,264.00	2.20
90	688083	中望软件	265,580.11	2.18
91	603516	淳中科技	262,971.00	2.16
92	300498	温氏股份	260,356.00	2.14
93	301153	中科江南	257,232.00	2.11
94	688687	凯因科技	252,713.55	2.08
95	603939	益丰药房	251,385.00	2.06
96	300725	药石科技	249,998.00	2.05
97	300937	药易购	247,315.00	2.03

98	300454	深信服	244,647.00	2.01
----	--------	-----	------------	------

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

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	62,960,923.90
卖出股票收入（成交）总额	63,405,550.31

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：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 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	42,511.24
2	应收清算款	90,881.46
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	925.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	134,318.32

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	户均持有的基金份	持有人结构
----	----------	-------

人户数(户)	额	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
561	14,242.58	29,646.37	0.37%	7,960,443.58	99.63%

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	27,430.39	0.34%

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	0~10
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(2016年07月06日)基金份额总额	28,475,095.52
本报告期期初基金份额总额	8,163,983.22
本报告期基金总申购份额	1,245,680.58
减：本报告期基金总赎回份额	1,419,573.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,990,089.95

§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，基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2023年2月15日，闫译文女士离任公司副总经理，刘伟先生离任公司督察长，闫译文女士任职公司督察长。

2、2023年3月22日，许家涵先生任职公司副总经理。

3、2023年6月17日，徐克磊先生离任公司总经理、财务负责人、首席信息官，董事长马铁刚先生代任公司总经理、财务负责人、首席信息官

2023年3月，项寅同志担任上海银行股份有限公司资产托管部副总经理职务，上述人事变动已进行备案、公告。

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，本基金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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，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	
东方证券	1	13,595,598.31	10.76%	12,661.41	10.81%	-
国信证券	1	53,153,898.04	42.06%	49,502.03	42.28%	-
海通证券	1	59,616,977.86	47.18%	54,925.32	46.91%	-

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、上述交易单元为本基金本报告期内全部租用的券商交易单元。

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
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天治基金管理有限公司旗下基金增加泰信财富为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2023-01-18
2	天治基金管理有限公司旗下基金2022年第4季度报告提示性公告、天治新消费灵活配置混合型证券投资基金20	中国证监会指定媒介	2023-01-20

	22年第4季度报告		
3	天治基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-02-15
4	天治基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定媒介	2023-03-22
5	天治基金管理有限公司旗下基金2022年年度报告提示性公告、天治新消费灵活配置混合型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-24
6	天治新消费灵活配置混合型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2023-04-21
7	天治基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-06-17

§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	20230101-20230630	3,262,174.05	0.00	0.00	3,262,174.05	40.83%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在持有基金份额超过20%的持有人，存在持有人大额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作出相应调整，现有投资组合中流动性较好的资产比例较高，20%以上份额持有人的大额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

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予天治成长精选混合型证券投资基金变更注册为天治新消费灵活配置混合型证券投资基金的文件

2. 《天治新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《天治新消费灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 《天治新消费灵活配置混合型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. 报告期内天治新消费灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿

12.2 存放地点

天治基金管理有限公司办公地点-上海市复兴西路159号。

12.3 查阅方式

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

2. 网站查询：www.chinanature.com.cn

天治基金管理有限公司
二〇二三年八月二十九日