

天治新消费灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：天治基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 23 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。

本基金于 2016 年 7 月 6 日由原天治成长精选混合型证券投资基金转型而来。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	6
2.2 基金产品说明（转型前）	10
2.3 基金管理人和基金托管人	10
2.4 信息披露方式	10
2.5 其他相关资料	10
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	11
3.1 主要会计数据和财务指标	11
3.2 基金净值表现（转型后）	12
3.2 基金净值表现（转型前）	14
3.3 其他指标	16
3.4 过去三年基金的利润分配情况	16
§4 管理人报告	16
4.1 基金管理人及基金经理情况	16
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	19
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	21
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	22
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	22
4.10 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	23
§5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	23
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	23
§6 审计报告（转型后）	23
6.1 审计报告基本信息	23
6.2 审计报告的基本内容	24
§6 审计报告（转型前）	24
6.1 审计报告基本信息	24
6.2 审计报告的基本内容	25
§7 年度财务报表（转型后）	26
7.1 资产负债表（转型后）	26
7.2 利润表	27
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	28
7.4 报表附注	29

§7 年度财务报表（转型前）	51
7.1 资产负债表（转型前）	51
7.2 利润表	52
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	53
7.4 报表附注	54
§8 投资组合报告（转型后）	77
8.1 期末基金资产组合情况	77
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	78
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	78
8.2 报告期内股票投资组合的重大变动	79
8.3 期末按债券品种分类的债券投资组合	91
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	91
8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	91
8.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	91
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	91
8.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	91
8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	91
8.10 投资组合报告附注	92
§8 投资组合报告（转型前）	93
8.1 期末基金资产组合情况	93
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	93
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	94
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	95
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	103
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	103
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	103
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	104
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	104
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	104
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	104
8.12 投资组合报告附注	104
§9 基金份额持有人信息（转型后）	105
9.3 期末基金份额持有人户数及持有人结构	105
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	106
9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	106
§9 基金份额持有人信息（转型前）	106
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	106
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	106
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	107
§10 开放式基金份额变动(转型后)	107
§10 开放式基金份额变动(转型前)	107
§11 重大事件揭示	107
11.1 基金份额持有人大会决议	107
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	108
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	108

11.4 基金投资策略的改变	108
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	109
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	109
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	109
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	110
11.9 其他重大事件（转型后）	111
11.9 其他重大事件（转型前）	113
§12 影响投资者决策的其他重要信息	错误！未定义书签。
§13 备查文件目录	118
13.1 备查文件目录	118
13.2 存放地点	118
13.3 查阅方式	118

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

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 7 月 6 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	16,043,937.69 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	天治成长精选混合型证券投资基金
基金简称	天治成长精选混合
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	2011 年 8 月 4 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	28,489,297.15 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型后）

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	1、资产配置策略 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。 2、股票投资策略 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。 （1）本基金对新消费主题的界定 我国消费结构正在发生深刻变化，以消费新热点、消费新模式为主要内容的消费升级，将引领相关产业、基础设施和公共服务投资迅速成长，拓展未来发展新空间。本基金所界定的新消费，不仅包括传统狭义的实物消费和劳务消费，还包括受益于我国消费结构变化及消费升级的新消费领域。 传统狭义的消费行业是指生产消费品的行业。按消费对象划分可分为两类：一类是实物消费，即以商品形式存在的消费品的消费。另一类是劳务消费，即以劳务形式存在的消费品的消费。 新消费领域包括如下方面： 服务消费。如职业技能培训、文化艺术培训等教育培训消费，健康管理、体育健身、高端医疗、生物医药等健康消费，家政服务和老年用品、照料护理等养老产业及适老化改造，动漫游戏、创意设计、网络文化、数字内容等新兴文化产业的消费。 信息消费。如云计算、大数据、物联网等基础设施建设，以及可穿戴设备、智能家居等智能终端相关技术研发和产品服务。 绿色消费。如生态农业、新能源、节能环保、资源综合利用、环境保护与污染治理、生态保护与修复等领域。 时尚消费。如消费者体验、个性化设计、柔性制造等相关的产业。还有通用航空、邮轮等传统高端消费。 品质消费。随着居民收入水平不断提高，广大消费者特别是中等收入群体对消费质量提出了更高要求，更加安全实用、更为舒适美观、更有品味格调的品牌商品消费发展潜力巨大。这类消费涉及几乎所有传统消费品和服务，将会带动传统产业改造提升和产品升级换代。 农村消费。农村消费在交通通信、文化娱乐、绿色环保、家电类耐用消费品和家用轿车等方面还有很大提升空间。适宜农村地区的分布式能源、农业废弃物资源化综合利用和垃圾污水处理设施、农村水电路气信息等基础设施建设改造投资潜力巨大。 （2）个股投资策略 本基金采取定性和定量相结合的分析方法，结合消费
--	---

	行业的特点，对评估备选公司进行研究，从中选择具有核心竞争优势和长期持续增长模式的公司，从而确定基金的股票组合。 1) 定性分析 内生增长分析：即通过分析公司的商业模式、竞争优势、行业前景等方面来选择业绩增速最快、持续性更强的公司。 ①商业模式——从价值价值定位、目标市场、营销方式、管理体制、组织结构、业务流程、盈利能力、扩张潜力等方面研判备选公司的增长持续性、利润弹性以及扩张潜力，从中寻找商业模式独特、具备较强的技术创新能力并保持足够的研发投入以推动企业的持续发展的企业。 ②竞争优势——从品牌、渠道、管理等方面研判挑选出优势公司。 ③行业前景——从行业规模、行业景气周期、增长速度、行业竞争格局等方面分析，重点关注“互联网+”、国家政策支持受益行业中的优质公司。 外延增长分析：即发掘具有资金优势、能通过上市、并购重组等方式实现外延式扩张的企业，以及有被并购后有投资价值的公司，从而配置股票池。 ①上市和并购重组——发掘消费行业中具有资金优势的，通过整体上市、并购（包括规模型购并、功能型购并、组合型购并、产业型购并）、战略参股、战略性资产剥离等事件的公司，研判其是否可以借机实现公司经营规模扩张、业绩增长和估值溢价。 ②被并购价值——发觉由于各种外部原因，企业价值被明显低估，可能被并购，并且被并购后，经营能力得到改善、估值上升的公司。 2) 定量分析 在精选消费行业股票的基础上，本基金采用以下方法分析其估值水平：市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市销率法（P/S）、近三年平均净资产收益率（ROE）、近三年平均资本回报率（ROIC）、市盈率—长期成长法（PEG）、企业价值/销售收入（EV/SALES）、企业价值/息税折旧摊销前利润法（EV/EBITDA）等。通过估值水平分析，发掘出价值被低估或估值合理的股票。 3、债券投资策略 在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向、发行人情况和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术选择个券，选择被价格低估的债券进行投资。
--	---

	本基金投资于中小企业私募债。由于中小企业私募债券整体流动性相对较差，且整体信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。 4、权证投资策略 本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。 5、资产支持证券投资策略 资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 6、股指期货投资策略 本基金在进行股指期货投资时，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值或期限套利等操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。 今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。
业绩比较基准	申银万国消费品指数收益率 $\times$ 50%+中证全债指数收益率 $\times$ 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。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金通过精选收益增长速度快、未来发展潜力大的成长性股票，以追求持续稳健的超额收益。
投资策略	本基金综合运用灵活而有纪律的资产配置策略和精选证券策略。在组合构建上，本基金采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”股票投资策略相结合的方式。通过精选持续性成长、趋势性成长和周期性成长股票，不断优化组合，追求稳定的资本增值。
业绩比较基准	沪深300成长指数收益率×75%+中证国债指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金属于主动投资的混合型基金，风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的品种。

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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵正中	闻怡
	联系电话	021-60371155	021-68475888
	电子邮箱	zhaozz@chinanature.com.cn	wenyi@bankofshanghai.com
客户服务电话		400-098-4800（免长途通话费用）、 021-60374800	95594
传真		021-60374934	021-68476936
注册地址		上海市浦东新区莲振路298号4号楼231室	上海市浦东新区银城中路168号
办公地址		上海市复兴西路159号	上海市浦东新区银城中路168号
邮政编码		200031	200120
法定代表人		赵玉彪	金煜

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.chinanature.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通	上海市世纪大道100号环球金融中

	合伙)	心 50 楼
注册登记机构	天治基金管理有限公司	上海市复兴西路 159 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-3,479,634.98
本期利润	-4,858,345.93
加权平均基金份额本期利润	-0.2430
本期加权平均净值利润率	-18.72%
本期基金份额净值增长率	-17.30%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	6,573,815.21
期末可供分配基金份额利润	0.4097
期末基金资产净值	22,617,752.90
期末基金份额净值	1.410
3.1.3 累计期末指标	2016 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	-17.30%

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

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

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

4、以上财务指标系按当年实际存续期计算。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-4,543,427.71	10,914,627.23	11,811,705.91
本期利润	-4,065,384.23	6,450,738.69	12,019,932.50
加权平均基金份额本期利润	-0.2212	0.3127	0.3043
本期加权平均净值利润率	-16.32%	16.22%	23.40%
本期基金份额净值增长率	-12.34%	17.88%	28.81%

3.1.2 期末数据和指标	2016 年 7 月 5 日	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	24,692,402.15	18,165,334.59	12,018,828.46
期末可供分配基金份额利润	0.8667	1.0709	0.4216
期末基金资产净值	48,565,745.92	32,984,563.72	47,040,760.46
期末基金份额净值	1.705	1.945	1.650
3.1.3 累计期末指标	2016 年 7 月 5 日	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	70.50%	94.50%	65.00%

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

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

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

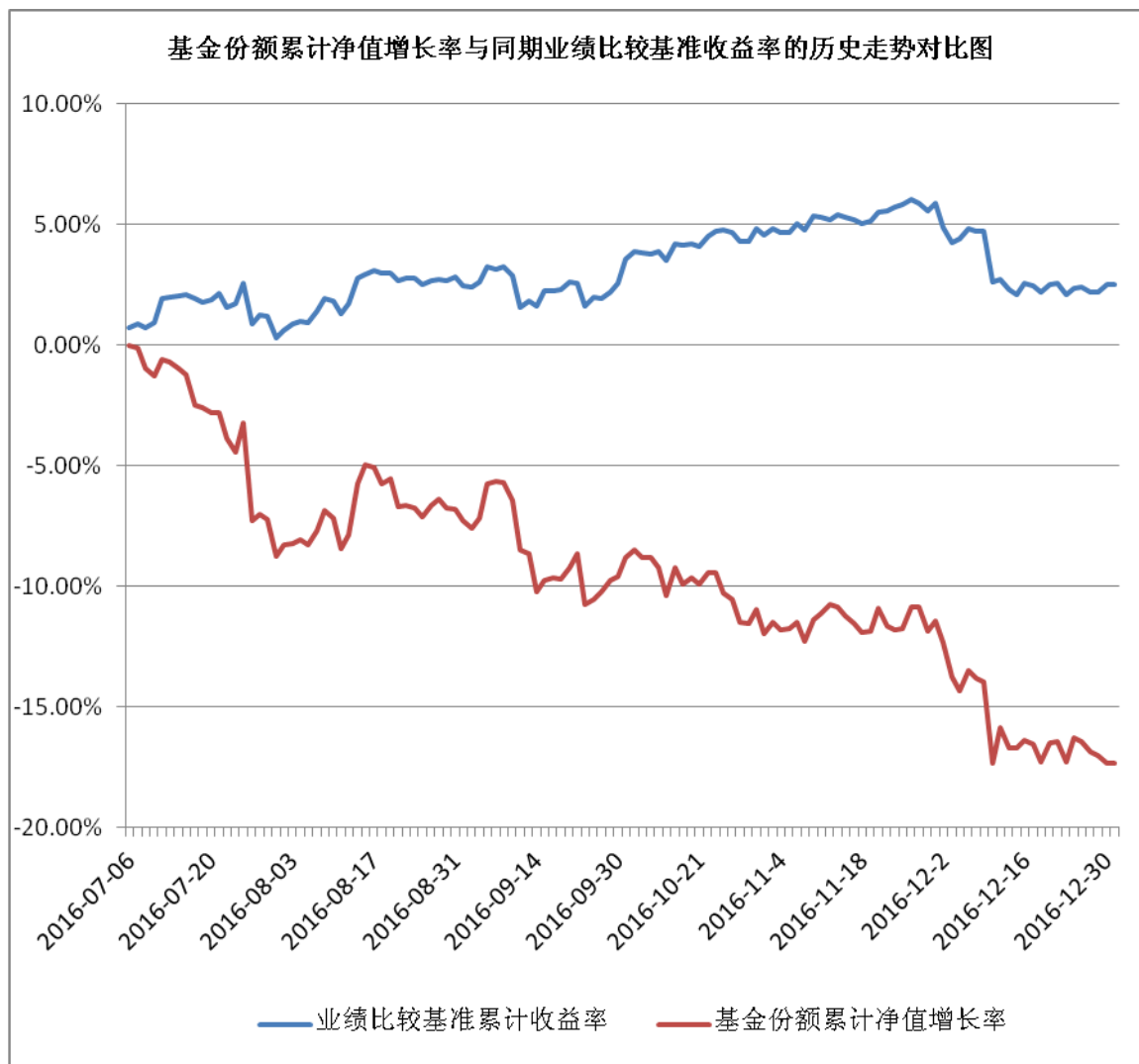
4、以上财务指标系按当年实际存续期计算。

3.2 基金净值表现（转型后）

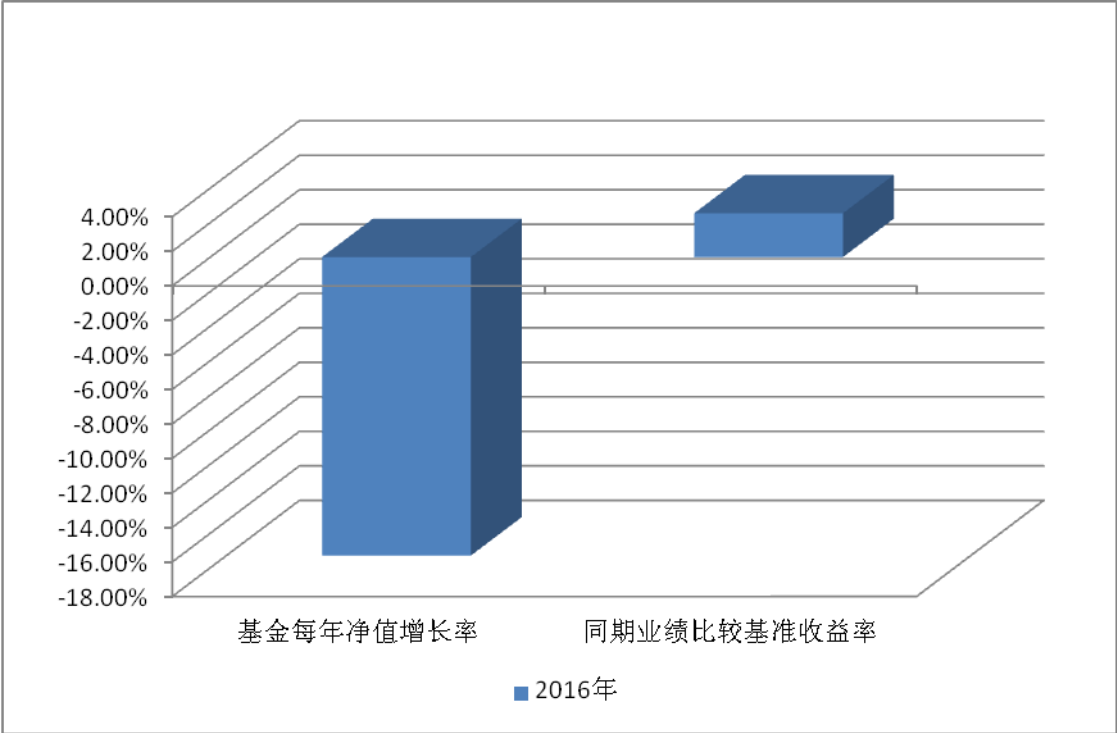
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-8.56%	0.86%	-0.02%	0.41%	-8.54%	0.45%
自基金合同生效起至今	-17.30%	0.91%	2.54%	0.43%	-19.84%	0.48%

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



3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

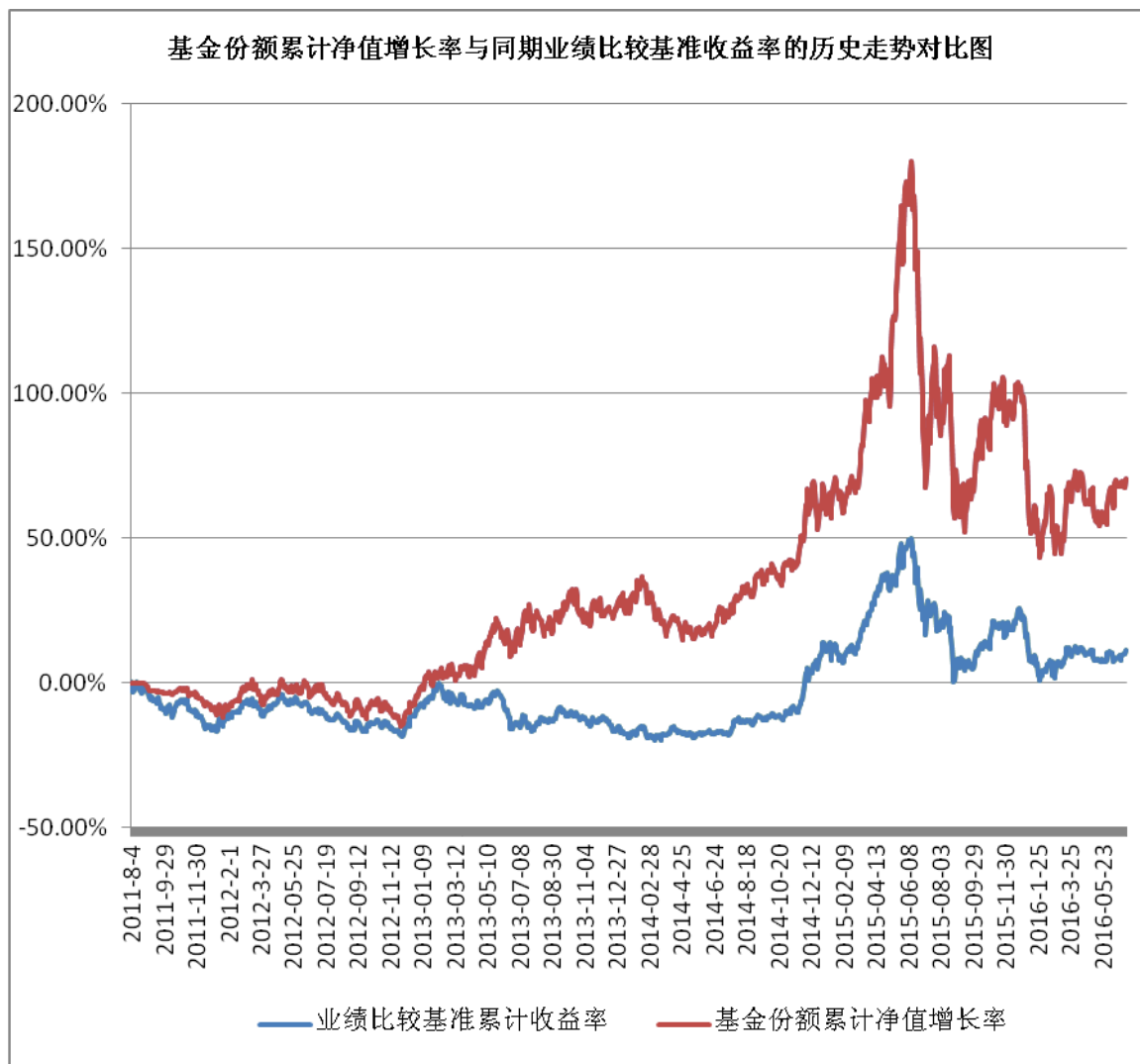


3.2 基金净值表现（转型前）

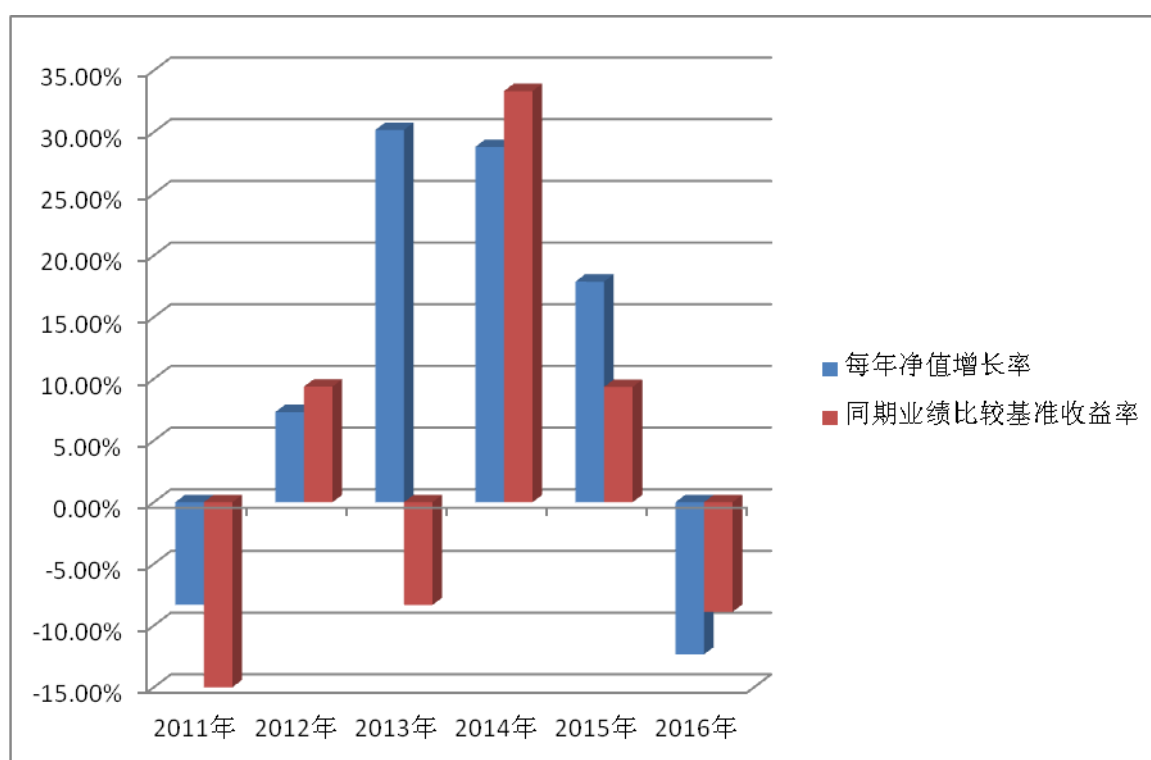
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.07%	1.59%	-0.03%	0.80%	1.10%	0.79%
过去六个月	-5.01%	2.29%	-3.68%	1.32%	-1.33%	0.97%
过去一年	-9.45%	2.75%	-8.48%	1.68%	-0.97%	1.07%
过去三年	44.61%	2.15%	29.43%	1.37%	15.18%	0.78%
自基金合同生效起至今	70.50%	1.84%	10.99%	1.25%	59.51%	0.59%

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 其他指标

注：无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自 2016 年 7 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人——天治基金管理有限公司于 2003 年 5 月成立，注册资本 1.6 亿元，注册地为上海。公司股权结构为：吉林省信托有限责任公司出资 9800 万元，占注册资本的 61.25%；中国吉林森林工业集团有限责任公司出资 6200 万元，占注册资本的 38.75%。截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人旗下共有十一只开放式基金，除本基金外，另外十只基金——天治稳健双盈债券型证券投资基金、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)、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、天治财富增长证券投资基金、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)、天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的基金合同分别于 2008 年 11 月 5 日、2016 年 4 月 18 日、2006 年 1 月 20 日、2006 年 7 月 5 日、2016 年 4 月 7 日、2009 年 7 月 15 日、2004 年 6 月 29 日、2013 年 6 月 4 日、2015 年 6 月 9 日、2016 年 12 月 7 日生效。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型后)

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尹维国	研究发展部总监、本基金基金经理、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015 年 3 月 27 日	—	6	2010 年 8 月至今就职于天治基金管理有限公司, 历任助理研究员、行业研究员、研究发展部总监助理, 现任研究发展部总监、本基金的基金经理、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注: 1、表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型前)

注: 1、表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。

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。

4.3 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》、《天治成长精选混合型证券投资基金基金合同》、《天治成长精选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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度。并在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，交易系统将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合。

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

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

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

具体方法如下：

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

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

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

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

4.4.2 公平交易制度的执行情况

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

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易的情形。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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年 A 股受多因素共振触发了年初的震荡行情，其中人民币贬值资本外流、产业资本减持预期、熔断机制导致流动性缺失等为直接导火索，但深层的原因则是经济放缓、企业盈利不佳，估值水平较高等综合性因素。进入第二季度，国内宏观政策和流动性趋于稳定，但市场对政策如何平衡调结构和稳增长之间的关系仍存有疑虑，同时外部环境的扰动因素加大，资本市场仍然以存量博弈为主。二季度外部因素成为市场主要关注点，MSCI 最终没有纳入 A 股指数、美联储没有加息、英国公投脱欧等几个靴子落地都对 A 股市场产生了较大的影响。整个上半年的市场运行过程中，市场监管部门为整顿市场，不断的推出新举措稳定市场，高压的“监管风暴”对遏制市场过分炒作起到了一定的作用。2016 年下半年整体宏观环境有所变化，供给侧改革渠道成效，物价指数有所抬头，CPI 继续回升，PPI 上涨幅度超预期，利率拐点显现；房地产调控政策密集出台，地产开始进入调整周期；人民币汇率贬值压力仍然较大。政策方面，国企改革和供给侧改革持续推进、PPP 政策暖风频吹，项目加速落地。“中央经济工作会议”对 2017 年的政策指引出台，提出三大问题：稳中求进、深化改革、防范风险。公报淡化经济增长目标，强化了改革预期和风险管控，引导市场脱虚向实。在整个“降杠杆—杀估值”的过程中，市场风险偏好降低，在存量博

弈市场中，贯穿全年的是主线是“价值回归、业绩为王”。而中小创的受到估值偏高、内生不足、外延受限等多重因素制约表现较差。其中，业绩稳定估值合理的消费板块（如食品饮料、家电等）、部分高景气度行业（新能源汽车、半导体、煤炭等）以及受益于政策红利的基建、PPP 等领域取得了较大的超额收益。

报告期内，本基金在年中完成了产品改造，由原来全市场投资的“天治成长精选混合型基金”变更为主要专注于“新消费”领域的“天治新消费混合基金”。在经济转型、内忧外患的阶段，本基金主要锁定内生驱动较强，以需求引导为主要线索的“新消费”领域，其中主要包括“文体教卫”、智能汽车、旅游、新传媒、游戏/电竞、新网络经济等。

本基金在上半年取得了超越市场的表现，通过仓位来控制来降低系统性风险的影响，通过结构调整来取得超额收益，在市场见底反弹的过程中，有效的把握了创业板反弹的机会，主要来自于对中小创中的“文体教卫”领域配置较多，并且结构上加大了对“新能源汽车、智能汽车、半导体”等板块的配置，获得了超越市场的表现。

本基金在年中进行产品改造，阶段性的对产品的操作产生了一定的影响，改造完成之后，市场风格变化趋于主板中的价值蓝筹，而本基金专注的“新消费”领域板块整体表现不佳，受到估值，内生增速下滑，外延受阻等多方面因素影响，净值表现落后于大盘。本基金在合理控制组合仓位的情况下，在电子、建筑、非银、家电等板块取得了一定的超额收益。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止转型前报告期末（2016 年 1 月 1 日-2016 年 7 月 5 日），本基金份额净值为 1.705 元，报告期末前一年份额净值增长率为-9.45%，业绩比较基准收益率为-8.48%，低于同期业绩比较基准收益率 0.97%。

截止转型后报告期末（2016 年 7 月 6 日-2016 年 12 月 31 日），本基金份额净值为 1.410 元，份额净值增长率为-17.30%，业绩比较基准收益率为 2.54%，低于同期业绩比较基准收益率 19.84%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，从政策指引的角度来看，“脱虚向实”和“防风险”是主基调。本基金认为，政策基调主要贯彻中央经济工作会议中的三大问题：“稳中求进、深化改革、防范风险”，公报淡化经济增长目标，强化了改革预期和风险管控，引导市场脱虚向实。其中要重视六大观点：1）改革供给、防范风险；2）深化“三去一降一补”；3）改革农业结构性供给侧；4）创新驱动经济

发展；5）地产平稳健康发展；6）改革开放推向纵深。另外，需要重视的是货币政策的转向，在供给侧改革成效显现，以及输入型通胀预期的背景下，本基金认为货币政策稳中偏紧，而流动性预期的变化导致股市不具备大幅上行的基础，但随着市场对未来经济回暖的预期加强，市场有可能演绎成为震荡上行的趋势。2017 年养老金将入市、A 股将被纳入 MSCI 指数，险资入市、房地产资金等因素或导致股市变成“弱增量博弈”市场，股市相对由于其他大类资产具有相对优势，主要关注领域包括：农业供给侧改革、国企改革、“一带一路”、基建、以及稳定增长的价值蓝筹。

内部注重货币政策，外部主要风险点在于，随着美国新任总统特朗普的正式就职，贸易保护主义、孤立主义等反全球化将会增加全球贸易的摩擦，尤其对中国低端产业造成较大冲击，央行的汇率政策将会受到来自美国等国的压力，而国内的弱周期复苏可持续性尚有显著的不确定性、通胀已经有所抬头，以上使得市场将会存在一定的不确定性。

2017 年，本基金以价值投资理念为主导，紧跟政策，积极的应对市场的变化。其中对于抗通胀、基建、一带一路、国企改革、周期复苏等领域会积极关注，为投资者创造价值。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年，本基金管理人内部监察稽核工作继续坚持规范运作、防范风险、维护投资人利益的原则，在进一步完善、优化公司内控制度的基础上，严格依据法律法规和公司内控制度监督前台各部门日常工作，切实防控公司运营和投资组合运作的风险，保障公司稳步发展。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作主要包括以下几个方面：

一、进一步完善、优化公司内控制度，加强监察稽核力度。

报告期内，公司制定或修订了《交易部业务手册》、《银行间债券市场交易管理办法》、《专户投资部管理制度》、《员工投资证券投资基金管理办法》、《投资管理人员利益冲突管理制度》、《规章制度管理办法》、《风险准备金制度》、《天治基金管理有限公司固有资金运作管理制度》、《风险控制制度》、《股指期货风险管理制度》、《股指期货投资管理制度》、《国债期货风险管理制度》、《国债期货投资管理制度》、《监察稽核制度》、《融资融券及转融通证券出借业务风险管理制度》、《融资融券及转融通证券出借业务投资管理制度》、《特定客户资产投资管理制度》、《特定客户资产管理业务风险控制制度》、《特定客户资产管理业务危机处理制度》、《特定客户资产管理业务记录及档案管理制度》，已经修改待过会的有《天治基金管理有限公司公募基金压力测试制度》、《计算机设备管理办法》、《天治基金专户业务第三方投资顾问机构管理制度》等管理制度。同时，监察稽核部继续严格依据法律法规和公司规章制度独立行使职责，通过定期或不定期检查、专项检查等方式，监督公司各项制度执行情况（监督监察内容包括但不限于投资组合的投资研究、投资决策、

交易执行和投资风险、绩效评估等情况、产品研发流程、基金销售、宣传推介、客户服务、信息技术日常处理及其安全情况、基金结算各项业务以及公司财务、人事状况等业务环节的合规情况), 及时发现情况, 提出改进建议并跟踪改进落实情况。

二、继续加强投资监控, 防范投资运作风险。

报告期内, 监察稽核部通过现场检查、电脑实时监控、人员询问、重点抽查等方式, 加强事前、事中、事后的风险管理, 同时产品创新及量化投资部通过定期对投资组合进行量化风险分析和绩效评估并提供风险分析报告和绩效评估报告等方式进行风险控制, 切实贯彻落实公平交易, 防范异常交易, 确保公司旗下投资组合合法合规运作, 切实维护投资人的合法利益。

报告期内, 本基金管理人所管理基金的运作合法合规, 充分维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理, 不断完善和优化操作流程, 充实和改进内控技术方法与手段, 进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性, 防范和控制各种风险, 合法合规、诚实信用、勤勉尽责地运作基金财产。

4.8 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、产品创新及量化投资部总监等, 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、固定收益部以及产品创新及量化投资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, 与产品创新及量化投资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。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内, 本基金未进行收益分配, 符合相关法律法规和基金合同的约定。

4.10 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

本基金报告期内存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，出现上述情形的时间段为 2016 年 7 月 6 日至 2016 年 12 月 31 日。本基金报告期内基金份额持有人数在 200 人以上。本基金管理人已于 2016 年 9 月 30 日向中国证监会报告了相关事项及解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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、《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托管协议》、《天治成长精选混合型证券投资基金基金合同》和《天治成长精选混合型证券投资基金托管协议》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，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2017）审字第 60467615_B08 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	天治新消费灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的天治新消费灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年 7 月 6 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人天治基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了天治新消费灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 7 月 6 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	朱宝钦	丁鹏飞
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

§ 6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2017）审字第 60467615_B13 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	天治成长精选股票型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的天治成长精选混合型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 7 月 5 日的资产负债表和 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人天治基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了天治成长精选混合型证券投资基金 2016 年 7 月 5 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	朱宝钦	丁鹏飞
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：天治新消费灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	3,177,514.47
结算备付金		358,543.67
存出保证金		117,914.59
交易性金融资产	7.4.7.2	18,594,752.00
其中：股票投资		18,594,752.00
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		786,921.40
应收利息	7.4.7.5	880.33
应收股利		-
应收申购款		2,456.32
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		23,038,982.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		142,134.24
应付管理人报酬		29,756.32
应付托管费		4,959.38
应付销售服务费		-

应付交易费用	7.4.7.7	176,550.46
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	67,829.48
负债合计		421,229.88
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	16,043,937.69
未分配利润	7.4.7.10	6,573,815.21
所有者权益合计		22,617,752.90
负债和所有者权益总计		23,038,982.78

注：（1）报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.410 元，基金份额总额 16,043,937.69 份。

（2）本基金由天治成长精选混合型证券投资基金转型而成，转型日为 2016 年 7 月 6 日

7.2 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：2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		-3,853,443.16
1. 利息收入		16,190.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	15,531.81
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		658.34
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,518,034.19
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-2,536,971.13
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	18,936.94
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,378,710.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	27,111.83
减：二、费用		1,004,902.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	188,998.09
2. 托管费	7.4.10.2.2	31,499.67
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	645,580.68
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	138,824.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,858,345.93
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,858,345.93

7.3 所有者权益（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：2016 年 7 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	28,489,297.15	20,076,448.77	48,565,745.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,858,345.93	-4,858,345.93
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）	-12,445,359.46	-8,644,287.63	-21,089,647.09
其中：1. 基金申购款	1,059,924.78	600,077.65	1,660,002.43
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-13,505,284.24	-9,244,365.28	-22,749,649.52
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）	16,043,937.69	6,573,815.21	22,617,752.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

常永涛

闫译文

黄宇星

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天治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。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）、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。本基金股票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。

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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于

在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 7 月 6 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2016 年 7 月 6 日至 2016 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债

券投资和衍生工具；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的

相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利

得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 权证投资工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股指期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

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

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；
- (3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- (4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- (2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (4) 每一基金份额享有同等分配权；
- (5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管

产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

7.4.6.4 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。

重要财务报表项目的说明

7.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	3,177,514.47
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	3,177,514.47

7.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	18,747,742.65	18,594,752.00	-152,990.65
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	18,747,742.65	18,594,752.00	-152,990.65

7.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.6.4 买入返售金融资产

7.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	665.85
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	161.30
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.08
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	53.10
合计	880.33

7.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	176,550.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	176,550.46

7.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8.68
预提费用	50,000.00
其他应付款其他	17,820.80
合计	67,829.48

7.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	28,489,297.15	28,489,297.15
本期申购	1,059,924.78	1,059,924.78
本期赎回（以“-”号填列）	-13,505,284.24	-13,505,284.24
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	16,043,937.69	16,043,937.69

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.6.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	27,235,991.43	-7,159,542.66	20,076,448.77
本期利润	-3,479,634.98	-1,378,710.95	-4,858,345.93
本期基金份额交易产生的变动数	-11,854,931.21	3,210,643.58	-8,644,287.63
其中：基金申购款	926,135.14	-326,057.49	600,077.65
基金赎回款	-12,781,066.35	3,536,701.07	-9,244,365.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,901,425.24	-5,327,610.03	6,573,815.21

7.4.6.11 存款利息收入

项目	本期 2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	11,445.82
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	3,081.84
其他	1,004.15
合计	15,531.81

7.4.6.12 股票投资收益**7.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	221,469,157.06
减：卖出股票成本总额	224,006,128.19
买卖股票差价收入	-2,536,971.13

7.4.6.13 债券投资收益**7.4.6.13.1 债券投资收益项目构成**

注：基金本报告期无债券投资收益。

7.4.6.13.2 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。

7.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.6.14 贵金属投资收益**7.4.6.14.1 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。

7.4.6.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.6.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.6.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.6.15 衍生工具收益**7.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	18,936.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,936.94

7.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-1,378,710.95
——股票投资	-1,378,710.95
——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	-
合计	-1,378,710.95

7.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	26,925.43
转换费收入	186.40
合计	27,111.83

7.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	645,580.68
银行间市场交易费用	-
合计	645,580.68

7.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	24,453.93
信息披露费	73,361.79
其他	40,000.00
账户维护费	-
银行汇划费用	1,008.61
律师费	-
合计	138,824.33

7.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

天治基金管理有限公司	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
吉林省信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国吉林森林工业集团有限责任公司	基金管理人的股东
天治北部资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

7.4.9 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。

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

注：无

7.4.9.1.2 债券交易

注：无

7.4.9.1.3 债券回购交易

注：无

7.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的应支付关联方的佣金。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 7 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	188,998.09
其中：支付销售机构的客户维护费	55,648.44

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。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
当期应支付的托管费	31,499.67	

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、公休日等，支付日期顺延。

7.4.9.2.3 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。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 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未运用固有资金投资本基金。

7.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.9.5 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	
	2016 年 7 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	3,177,514.47	11,445.82

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10 利润分配情况

7.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.11 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.11.2 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
000887	中鼎股份	2016 年 11 月 18 日	筹划重大 事项	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	28,000	740,819.00	726,320.00	

7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12 金融工具风险及管理

7.4.12.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以内部控制委员会为核心的、由督察长、内部控制委员会、监察稽核部、

相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.12.2 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。

15.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

15.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

注：无

7.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.12.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

7.4.12.4 市场风险

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

7.4.12.4.1 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。

7.4.12.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2016 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	3,177,514.47	-	-	-	-	-	3,177,514.47
结算备付金	358,543.67	-	-	-	-	-	358,543.67
存出保证金	117,914.59	-	-	-	-	-	117,914.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-	18,594,752.00	18,594,752.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	786,921.40	786,921.40
应收利息	-	-	-	-	-	880.33	880.33
应收申购款	-	-	-	-	-	2,456.32	2,456.32
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,653,972.73	-	-	-	-	19,385,010.05	23,038,982.78
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	142,134.24	142,134.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	29,756.32	29,756.32
应付托管费	-	-	-	-	-	4,959.38	4,959.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	176,550.46	176,550.46
其他负债	-	-	-	-	-	67,829.48	67,829.48
负债总计	-	-	-	-	-	421,229.88	421,229.88
利率敏感度缺口	3,653,972.73	-	-	-	-	18,963,780.17	22,617,752.90

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期末未持有债券资产，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。

7.4.12.4.2 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。

7.4.12.4.3 其他价格风险

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

7.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	18,594,752.00	82.21
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	18,594,752.00	82.21

7.4.12.4.3.2 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（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准变动+5%	2,046,523.50
	业绩比较基准变动-5%	-2,046,523.50

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

7.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 17,868,432.00 元，属于第二层次的余额为人民币 726,320.00 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层级公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：天治成长精选混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 7 月 5 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 7 月 5 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	3,922,364.65	5,379,228.64
结算备付金		452,007.77	439,764.64
存出保证金		119,503.54	151,235.20
交易性金融资产	7.4.7.2	44,604,001.30	27,769,055.30
其中：股票投资		44,604,001.30	27,723,611.30
基金投资		-	-
债券投资		-	45,444.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		997,272.26	94.33
应收利息	7.4.7.5	8,062.90	1,030.26
应收股利		-	-
应收申购款		98.81	74.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		50,103,311.23	33,740,483.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 7 月 5 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		915,316.19	-
应付赎回款		4,918.43	261,921.36
应付管理人报酬		10,198.60	43,252.88
应付托管费		1,699.76	7,208.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	485,408.72	225,685.59
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	120,023.61	217,850.90
负债合计		1,537,565.31	755,919.54
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	28,489,297.15	16,962,384.30
未分配利润	7.4.7.10	20,076,448.77	16,022,179.42
所有者权益合计		48,565,745.92	32,984,563.72
负债和所有者权益总计		50,103,311.23	33,740,483.26

注：1、报告截止日 2016 年 7 月 5 日，基金份额净值 1.705 元，基金份额总额 28,489,297.15 份。

2、本基金自 2016 年 7 月 6 日起转型为天治新消费灵活配置混合型证券投资基金。

7.2 利润表

会计主体：天治成长精选混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-3,072,120.05	8,572,629.68
1. 利息收入		31,465.00	51,079.90
其中：存款利息收入	7.4.7.11	28,521.74	45,621.03
债券利息收入		17.03	2,727.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,926.23	2,731.66
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,595,009.26	12,924,457.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,710,586.08	13,107,873.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-4,529.64	-405,665.64
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	120,106.46	222,249.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	478,043.48	-4,463,888.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	13,380.73	60,981.22

列)			
减：二、费用		993,264.18	2,121,890.99
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	227,763.29	596,469.29
2. 托管费	7.4.10.2.2	37,960.51	99,411.50
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	608,202.15	1,205,624.70
5. 利息支出		-	447.22
其中：卖出回购金融资产支出		-	447.22
6. 其他费用	7.4.7.20	119,338.23	219,938.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,065,384.23	6,450,738.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,065,384.23	6,450,738.69

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治成长精选混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 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）	16,962,384.30	16,022,179.42	32,984,563.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,065,384.23	-4,065,384.23
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）	11,526,912.85	8,119,653.58	19,646,566.43
其中：1. 基金申购款	18,366,237.22	12,764,902.37	31,131,139.59
2. 基金赎回款	-6,839,324.37	-4,645,248.79	-11,484,573.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	28,489,297.15	20,076,448.77	48,565,745.92
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	28,504,542.31	18,536,218.15	47,040,760.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,450,738.69	6,450,738.69
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）	-11,542,158.01	-8,964,777.42	-20,506,935.43
其中：1. 基金申购款	24,463,478.14	25,225,629.16	49,689,107.30
2. 基金赎回款	-36,005,636.15	-34,190,406.58	-70,196,042.73
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）	16,962,384.30	16,022,179.42	32,984,563.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>常永涛</u>	<u>闫译文</u>	<u>黄宇星</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天治成长精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[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。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。本基金于 2015 年 8 月 4 日起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》，本基金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，本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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票资产占基金资产的 60%-95%，其中，投资于成长性股票的资产占股票资产的比例不低于 80%；债券、货币市场工具、权证、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 成长指数收益率 $\times$ 75%+中证国债指数收益率 $\times$ 25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》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。

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》，本基金于 2016 年 7 月 6 日起转型为天治新消费灵活配置混合型证券投资基金继续运作，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 7 月 5 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的

终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（2）债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

（3）权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（4）分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算；

（5）回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异

较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

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

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；
- (3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- (4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- (2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截至日；
- (4) 每一基金份额享有同等分配权；
- (5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 营业税、增值税

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，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通

知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

7.4.6.4 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 7 月 5 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	3,922,364.65	5,379,228.64
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,922,364.65	5,379,228.64

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 7 月 5 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		43,378,281.00	44,604,001.30	1,225,720.30
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		43,378,281.00	44,604,001.30	1,225,720.30
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		26,975,496.22	27,723,611.30	748,115.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	45,882.26	45,444.00	-438.26
	银行间市场	-	-	-
	合计	45,882.26	45,444.00	-438.26
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		27,021,378.48	27,769,055.30	747,676.82

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 7 月 5 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	7,770.87	733.21
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	219.89	197.90
应收债券利息	-	31.15
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.08	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	72.06	68.00
合计	8,062.90	1,030.26

7.4.7.6 其他资产

注：无

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 7 月 5 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	485,408.72	225,685.59
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	485,408.72	225,685.59

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 7 月 5 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	18.53	30.10
预提费用	102,184.28	200,000.00
其他应付款其他	17,820.80	17,820.80
合计	120,023.61	217,850.90

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,962,384.30	16,962,384.30
本期申购	18,366,237.22	18,366,237.22
本期赎回（以“-”号填列）	-6,839,324.37	-6,839,324.37
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	28,489,297.15	28,489,297.15

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	20,979,372.59	-4,957,193.17	16,022,179.42
本期利润	-4,543,427.71	478,043.48	-4,065,384.23
本期基金份额交易产生的变动数	10,800,046.55	-2,680,392.97	8,119,653.58
其中：基金申购款	17,482,906.13	-4,718,003.76	12,764,902.37
基金赎回款	-6,682,859.58	2,037,610.79	-4,645,248.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,235,991.43	-7,159,542.66	20,076,448.77

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
----	--------------------------------------	---

活期存款利息收入	22,936.67	37,670.75
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	2,897.08	5,476.66
其他	2,687.99	2,473.62
合计	28,521.74	45,621.03

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年7月5日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
卖出股票成交总额	195,188,258.83	406,952,898.93
减：卖出股票成本总额	198,898,844.91	393,845,025.46
买卖股票差价收入	-3,710,586.08	13,107,873.47

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年7 月5日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,529.64	-405,665.64
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	-4,529.64	-405,665.64

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年7 月5日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	41,400.80	5,583,258.35

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	45,882.26	5,957,442.51
减：应收利息总额	48.18	31,481.48
买卖债券差价收入	-4,529.64	-405,665.64

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

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

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	120,106.46	222,249.27
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	120,106.46	222,249.27

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	478,043.48	-4,463,888.54
——股票投资	477,605.22	-4,463,450.28
——债券投资	438.26	-438.26
——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	-	-
合计	478,043.48	-4,463,888.54

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	12,535.07	48,883.19
转换费收入	845.66	12,098.03
合计	13,380.73	60,981.22

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	608,202.15	1,205,624.70
银行间市场交易费用	-	-
合计	608,202.15	1,205,624.70

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	25,546.07	50,000.00
信息披露费	76,638.21	150,000.00
其他	10,200.00	200.00
账户维护费	6,000.00	18,000.00
银行汇划费用	953.95	1,738.28
合计	119,338.23	219,938.28

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除（上述利润分配事项及在）7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天治基金管理有限公司	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
吉林省信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国吉林森林工业集团有限责任公司	基金管理人的股东
天治北部资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**7.4.10.1.1 股票交易**

注：无

7.4.10.1.2 债券交易

注：无

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	227,763.29	596,469.29
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	61,593.38	173,829.85

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	37,960.51	99,411.50

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、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 5 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行	3,922,364.65	22,936.67	5,379,228.64	37,670.75

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016 年 7 月 5 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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
002280	联络互动	2016 年 4 月 25 日	筹划重大事项	19.71	2016 年 10 月 25 日	21.68	30,000	553,950.81	591,300.00	-
002445	中南文化	2016 年 6 月 14 日	筹划重大事项	22.99	2016 年 9 月 21 日	20.69	25,000	547,000.00	574,750.00	-
600576	万家文化	2016 年 4 月 11 日	筹划重大事项	22.21	2016 年 9 月 13 日	20.12	70,200	1,268,772.87	1,559,142.00	-
300292	吴通控股	2016 年 1 月 25 日	筹划重大事项	39.22	2016 年 7 月 20 日	36.48	19,401	913,049.05	760,907.22	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 7 月 5 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 7 月 5 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

17.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

17.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：无

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金

持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金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、债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2016 年 7 月 5 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	3,922,364.65	-	-	-	-	-	3,922,364.65
结算备付金	452,007.77	-	-	-	-	-	452,007.77
存出保证金	119,503.54	-	-	-	-	-	119,503.54
交易性金融资产	-	-	-	-	-	44,604,001.30	44,604,001.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	997,272.26	997,272.26
应收利息	-	-	-	-	-	8,062.90	8,062.90
应收申购款	-	-	-	-	-	98.81	98.81
资产总计	4,493,875.96	-	-	-	-	45,609,435.27	50,103,311.23
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	915,316.19	915,316.19
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,918.43	4,918.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,198.60	10,198.60
应付托管费	-	-	-	-	-	1,699.76	1,699.76
应付交易费用	-	-	-	-	-	485,408.72	485,408.72
其他负债	-	-	-	-	-	120,023.61	120,023.61
负债总计	-	-	-	-	-	1,537,565.31	1,537,565.31
利率敏感度缺口	4,493,875.96	-	-	-	-	-44,071,869.96	48,565,745.92

上年度末 2015 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	5,379,228.64	-	-	-	-	-	5,379,228.64
结算备付金	439,764.64	-	-	-	-	-	439,764.64
存出保证金	151,235.20	-	-	-	-	-	151,235.20
交易性金融资产	-	-	45,444.00	-	-	-27,723,611.30	27,769,055.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	94.33	94.33
应收利息	-	-	-	-	-	1,030.26	1,030.26
应收申购款	-	-	-	-	-	74.89	74.89
资产总计	5,970,228.48	-	45,444.00	-	-	-27,724,810.78	33,740,483.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	261,921.36	261,921.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	43,252.88	43,252.88
应付托管费	-	-	-	-	-	7,208.81	7,208.81
应付交易费用	-	-	-	-	-	225,685.59	225,685.59
其他负债	-	-	-	-	-	217,850.90	217,850.90
负债总计	-	-	-	-	-	755,919.54	755,919.54
利率敏感度缺口	5,970,228.48	-	45,444.00	-	-	-26,968,891.24	32,984,563.72

注：表中统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期末未持有债券资产，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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 7 月 5 日		2015 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	44,604,001.30	91.84	27,723,611.30	84.05
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	45,444.00	0.14
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	44,604,001.30	91.84	27,769,055.30	84.19

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 7 月 5 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准变动+5%	3,243,590.01	2,057,253.36
	业绩比较基准变动-5%	-3,243,590.01	-2,057,253.36

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 7 月 5 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为人民币 41,117,902.08 元，属于第二层级的余额为人民币 3,486,099.22 元，属于第三层级余额为人民币 0.00 元（于 2015 年 12 月 31 日，第一层级的余额为人民币 27,016,611.30 元，属于第二层级的余额为人民币 752,444.00 元，属于第三层级余额为人民币 0.00 元）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截止至资产负债表日，本基金无需要说明的重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告（转型后）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	18,594,752.00	80.71
	其中：股票	18,594,752.00	80.71
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	3,536,058.14	15.35
7	其他各项资产	908,172.64	3.94
8	合计	23,038,982.78	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,587,620.00	11.44
B	采矿业	547,650.00	2.42
C	制造业	11,210,982.00	49.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	3,280,050.00	14.50
F	批发和零售业	883,800.00	3.91
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	84,650.00	0.37
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	18,594,752.00	82.21

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	002456	欧菲光	50,700	1,737,996.00	7.68
2	600699	均胜电子	31,000	1,025,790.00	4.54
3	000651	格力电器	37,300	918,326.00	4.06
4	601933	永辉超市	180,000	883,800.00	3.91
5	000059	华锦股份	67,000	797,300.00	3.53
6	600068	葛洲坝	81,000	744,390.00	3.29
7	000887	中鼎股份	28,000	726,320.00	3.21
8	601117	中国化学	105,000	710,850.00	3.14
9	603899	晨光文具	39,000	709,800.00	3.14
10	000998	隆平高科	33,000	707,190.00	3.13
11	300385	雪浪环境	19,000	700,150.00	3.10
12	002310	东方园林	48,000	679,200.00	3.00
13	000930	中粮生化	50,000	672,000.00	2.97
14	600820	隧道股份	61,000	671,610.00	2.97
15	002326	永太科技	41,000	668,710.00	2.96
16	300106	西部牧业	41,000	661,330.00	2.92
17	601766	中国中车	67,000	654,590.00	2.89
18	600598	北大荒	53,500	652,700.00	2.89
19	601689	拓普集团	22,000	647,240.00	2.86
20	300136	信维通信	22,000	627,000.00	2.77
21	002041	登海种业	30,000	566,400.00	2.50
22	600547	山东黄金	15,000	547,650.00	2.42
23	600426	华鲁恒升	40,000	530,000.00	2.34
24	002475	立讯精密	24,000	498,000.00	2.20
25	600039	四川路桥	100,000	474,000.00	2.10
26	002701	奥瑞金	27,000	233,280.00	1.03
27	300059	东方财富	5,000	84,650.00	0.37
28	000716	黑芝麻	8,000	64,480.00	0.29

8.2 报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600068	葛洲坝	2,763,128.50	12.22
2	300017	网宿科技	2,640,747.00	11.68
3	000488	晨鸣纸业	2,630,424.00	11.63

4	300059	东方财富	2,609,823.00	11.54
5	002074	国轩高科	2,544,520.00	11.25
6	002673	西部证券	2,398,617.00	10.61
7	002456	欧菲光	2,260,389.80	9.99
8	000625	长安汽车	2,213,452.65	9.79
9	600690	青岛海尔	2,164,470.00	9.57
10	000401	冀东水泥	2,142,254.00	9.47
11	300385	雪浪环境	2,089,866.00	9.24
12	600547	山东黄金	2,065,041.10	9.13
13	002062	宏润建设	2,064,715.00	9.13
14	002597	金禾实业	2,004,084.00	8.86
15	000651	格力电器	1,977,165.00	8.74
16	600699	均胜电子	1,974,976.00	8.73
17	600597	光明乳业	1,914,557.00	8.46
18	603508	思维列控	1,883,562.00	8.33
19	603008	喜临门	1,795,737.00	7.94
20	000887	中鼎股份	1,749,518.00	7.74
21	300033	同花顺	1,745,916.00	7.72
22	600612	老凤祥	1,731,675.40	7.66
23	300136	信维通信	1,645,032.00	7.27
24	600711	盛屯矿业	1,629,476.00	7.20
25	600073	上海梅林	1,592,853.33	7.04
26	300207	欣旺达	1,578,982.00	6.98
27	000423	东阿阿胶	1,572,376.00	6.95
28	601688	华泰证券	1,568,246.00	6.93
29	002041	登海种业	1,563,211.14	6.91
30	002358	森源电气	1,501,644.00	6.64
31	002701	奥瑞金	1,500,264.80	6.63
32	600801	华新水泥	1,484,711.93	6.56
33	600409	三友化工	1,465,286.00	6.48
34	000060	中金岭南	1,435,834.00	6.35
35	002200	云投生态	1,432,165.00	6.33
36	002310	东方园林	1,428,569.00	6.32
37	600497	驰宏锌锗	1,420,857.00	6.28
38	601225	陕西煤业	1,395,673.00	6.17
39	002051	中工国际	1,391,453.80	6.15

40	002425	凯撒文化	1,377,848.00	6.09
41	601766	中国中车	1,366,340.00	6.04
42	002078	太阳纸业	1,363,773.00	6.03
43	601186	中国铁建	1,348,000.00	5.96
44	000501	鄂武商 A	1,345,386.00	5.95
45	603816	顾家家居	1,343,192.00	5.94
46	601618	中国中冶	1,315,300.00	5.82
47	300197	铁汉生态	1,309,555.90	5.79
48	300089	文化长城	1,307,018.96	5.78
49	300450	先导智能	1,302,663.00	5.76
50	603899	晨光文具	1,269,961.42	5.61
51	601336	新华保险	1,269,557.00	5.61
52	300011	鼎汉技术	1,257,255.00	5.56
53	300144	宋城演艺	1,255,908.00	5.55
54	002475	立讯精密	1,254,062.00	5.54
55	600436	片仔癀	1,221,704.00	5.40
56	600702	沱牌舍得	1,203,452.00	5.32
57	002533	金杯电工	1,187,309.00	5.25
58	002367	康力电梯	1,102,485.56	4.87
59	002340	格林美	1,083,200.00	4.79
60	300106	西部牧业	1,070,287.00	4.73
61	002131	利欧股份	1,069,006.00	4.73
62	000333	美的集团	1,063,256.00	4.70
63	300382	斯莱克	1,012,712.00	4.48
64	300351	永贵电器	978,168.00	4.32
65	002454	松芝股份	969,179.00	4.29
66	000059	华锦股份	965,125.00	4.27
67	002008	大族激光	954,161.00	4.22
68	002326	永太科技	940,628.00	4.16
69	600987	航民股份	902,337.68	3.99
70	002631	德尔未来	894,889.00	3.96
71	601233	桐昆股份	879,904.00	3.89
72	601933	永辉超市	852,347.00	3.77
73	603000	人民网	834,007.98	3.69
74	002245	澳洋顺昌	832,265.56	3.68
75	600754	锦江股份	823,766.00	3.64

76	000028	国药一致	821,444.00	3.63
77	300367	东方网力	820,700.00	3.63
78	000400	许继电气	815,367.78	3.60
79	002048	宁波华翔	806,627.00	3.57
80	300383	光环新网	793,295.00	3.51
81	600273	嘉化能源	792,590.00	3.50
82	601668	中国建筑	790,960.00	3.50
83	300014	亿纬锂能	789,995.00	3.49
84	000049	德赛电池	786,884.00	3.48
85	002327	富安娜	785,162.00	3.47
86	002372	伟星新材	781,113.60	3.45
87	002172	澳洋科技	778,041.00	3.44
88	601899	紫金矿业	772,200.00	3.41
89	002670	国盛金控	768,720.00	3.40
90	600777	新潮能源	767,062.00	3.39
91	600109	国金证券	766,348.00	3.39
92	600661	新南洋	765,441.00	3.38
93	600887	伊利股份	764,277.00	3.38
94	002037	久联发展	753,682.00	3.33
95	002500	山西证券	750,764.00	3.32
96	000799	酒鬼酒	748,860.00	3.31
97	002413	雷科防务	747,300.80	3.30
98	600999	招商证券	747,030.00	3.30
99	600418	江淮汽车	745,277.00	3.30
100	002303	美盈森	743,616.00	3.29
101	300088	长信科技	739,930.00	3.27
102	000636	风华高科	738,640.00	3.27
103	601006	大秦铁路	738,513.57	3.27
104	000776	广发证券	737,032.00	3.26
105	600259	广晟有色	736,220.00	3.26
106	601997	贵阳银行	735,511.00	3.25
107	002241	歌尔股份	735,023.00	3.25
108	000498	山东路桥	733,950.00	3.25
109	600958	东方证券	733,190.00	3.24
110	600006	东风汽车	732,411.00	3.24
111	603589	口子窖	726,880.00	3.21

112	600362	江西铜业	726,765.00	3.21
113	000070	特发信息	725,020.00	3.21
114	601788	光大证券	723,523.00	3.20
115	300287	飞利信	722,521.00	3.19
116	002271	东方雨虹	719,863.00	3.18
117	002127	南极电商	717,411.00	3.17
118	601800	中国交建	716,186.00	3.17
119	600584	长电科技	714,000.00	3.16
120	600756	浪潮软件	713,153.90	3.15
121	002024	苏宁云商	713,140.00	3.15
122	601199	江南水务	711,560.00	3.15
123	601198	东兴证券	709,527.62	3.14
124	000671	阳光城	708,400.00	3.13
125	600867	通化东宝	707,172.60	3.13
126	600278	东方创业	707,098.00	3.13
127	002007	华兰生物	707,056.60	3.13
128	300090	盛运环保	705,929.00	3.12
129	600803	新奥股份	705,849.00	3.12
130	600576	万家文化	705,600.00	3.12
131	000063	中兴通讯	704,640.00	3.12
132	600978	宜华生活	702,900.00	3.11
133	000858	五粮液	699,527.04	3.09
134	000807	云铝股份	699,503.00	3.09
135	600826	兰生股份	696,498.00	3.08
136	600820	隧道股份	694,620.00	3.07
137	002001	新和成	693,900.00	3.07
138	000596	古井贡酒	691,425.00	3.06
139	603766	隆鑫通用	689,576.00	3.05
140	000998	隆平高科	689,130.00	3.05
141	000568	泸州老窖	689,040.00	3.05
142	000983	西山煤电	688,987.00	3.05
143	000598	兴蓉环境	688,600.00	3.04
144	000930	中粮生化	688,520.00	3.04
145	000716	黑芝麻	688,214.00	3.04
146	600332	白云山	687,530.00	3.04
147	600567	山鹰纸业	686,633.00	3.04

148	600598	北大荒	685,835.00	3.03
149	601689	拓普集团	681,160.00	3.01
150	002292	奥飞娱乐	679,680.00	3.01
151	300364	中文在线	677,974.00	3.00
152	600643	爱建集团	677,400.00	2.99
153	600168	武汉控股	675,891.00	2.99
154	000915	山大华特	675,038.20	2.98
155	002281	光迅科技	674,548.20	2.98
156	600963	岳阳林纸	674,421.00	2.98
157	600977	中国电影	673,065.00	2.98
158	002321	华英农业	669,600.00	2.96
159	601117	中国化学	667,691.00	2.95
160	600525	长园集团	662,960.00	2.93
161	300043	星辉娱乐	661,888.04	2.93
162	300129	泰胜风能	661,410.00	2.92
163	000783	长江证券	657,590.00	2.91
164	300237	美晨科技	657,418.00	2.91
165	300078	思创医惠	656,756.60	2.90
166	600270	外运发展	656,700.00	2.90
167	000554	泰山石油	654,796.00	2.90
168	300133	华策影视	651,200.00	2.88
169	601801	皖新传媒	650,044.63	2.87
170	300115	长盈精密	648,200.00	2.87
171	000100	TCL 集团	646,200.00	2.86
172	002730	电光科技	642,980.20	2.84
173	601377	兴业证券	641,600.00	2.84
174	002410	广联达	640,036.00	2.83
175	601636	旗滨集团	638,472.00	2.82
176	002440	闰土股份	635,740.00	2.81
177	000970	中科三环	632,452.00	2.80
178	600061	国投安信	626,423.00	2.77
179	002196	方正电机	626,195.00	2.77
180	600667	太极实业	626,132.00	2.77
181	000404	华意压缩	625,739.00	2.77
182	600626	申达股份	621,656.00	2.75
183	002242	九阳股份	620,700.00	2.74

184	600146	商赢环球	614,445.00	2.72
185	002517	恺英网络	612,904.16	2.71
186	300369	绿盟科技	612,612.00	2.71
187	000039	中集集团	604,200.00	2.67
188	002081	金螳螂	588,775.00	2.60
189	002439	启明星辰	580,871.00	2.57
190	600500	中化国际	576,894.00	2.55
191	002050	三花智控	569,017.50	2.52
192	600651	飞乐音响	555,407.00	2.46
193	600426	华鲁恒升	527,212.00	2.33
194	600039	四川路桥	515,000.00	2.28
195	300379	东方通	514,800.00	2.28
196	600108	亚盛集团	476,800.00	2.11

8.2.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002673	西部证券	3,220,796.00	14.24
2	601688	华泰证券	2,885,227.82	12.76
3	603008	喜临门	2,866,302.33	12.67
4	300033	同花顺	2,712,062.84	11.99
5	000488	晨鸣纸业	2,649,403.00	11.71
6	300017	网宿科技	2,506,629.88	11.08
7	002074	国轩高科	2,400,642.00	10.61
8	300059	东方财富	2,390,600.00	10.57
9	002131	利欧股份	2,309,061.00	10.21
10	002271	东方雨虹	2,267,474.20	10.03
11	600547	山东黄金	2,249,247.34	9.94
12	300133	华策影视	2,219,403.10	9.81
13	000625	长安汽车	2,157,273.40	9.54
14	000401	冀东水泥	2,140,144.00	9.46
15	002062	宏润建设	2,103,823.54	9.30
16	600690	青岛海尔	2,097,428.00	9.27
17	002597	金禾实业	2,094,027.34	9.26
18	601198	东兴证券	2,066,297.85	9.14

19	600068	葛洲坝	2,023,876.75	8.95
20	600584	长电科技	1,982,245.00	8.76
21	600576	万家文化	1,963,107.00	8.68
22	300078	思创医惠	1,962,637.37	8.68
23	002048	宁波华翔	1,943,203.16	8.59
24	600597	光明乳业	1,920,518.00	8.49
25	601788	光大证券	1,851,374.36	8.19
26	600651	飞乐音响	1,841,365.00	8.14
27	300144	宋城演艺	1,840,261.70	8.14
28	603508	思维列控	1,830,934.00	8.10
29	002245	澳洋顺昌	1,784,169.18	7.89
30	600612	老凤祥	1,746,549.58	7.72
31	002500	山西证券	1,708,606.97	7.55
32	002413	雷科防务	1,692,787.00	7.48
33	600061	国投安信	1,681,376.00	7.43
34	600073	上海梅林	1,612,627.80	7.13
35	002517	恺英网络	1,591,954.19	7.04
36	300207	欣旺达	1,533,742.00	6.78
37	000423	东阿阿胶	1,492,965.00	6.60
38	600409	三友化工	1,459,004.72	6.45
39	002358	森源电气	1,458,774.00	6.45
40	600711	盛屯矿业	1,457,434.00	6.44
41	300336	新文化	1,456,509.00	6.44
42	000060	中金岭南	1,456,399.00	6.44
43	600497	驰宏锌锗	1,451,481.00	6.42
44	600801	华新水泥	1,444,479.00	6.39
45	002200	云投生态	1,421,561.25	6.29
46	300369	绿盟科技	1,420,864.00	6.28
47	002051	中工国际	1,393,346.17	6.16
48	002707	众信旅游	1,370,918.50	6.06
49	601225	陕西煤业	1,364,148.50	6.03
50	300197	铁汉生态	1,347,565.48	5.96
51	300385	雪浪环境	1,339,434.30	5.92
52	300031	宝通科技	1,334,277.00	5.90
53	002078	太阳纸业	1,329,745.27	5.88
54	000501	鄂武商 A	1,319,966.85	5.84
55	601186	中国铁建	1,310,746.00	5.80
56	601618	中国中冶	1,302,200.00	5.76

57	603816	顾家家居	1,296,403.00	5.73
58	601336	新华保险	1,289,282.00	5.70
59	002425	凯撒文化	1,265,756.00	5.60
60	300089	文化长城	1,258,651.09	5.56
61	300450	先导智能	1,243,476.00	5.50
62	002701	奥瑞金	1,242,109.58	5.49
63	600436	片仔癀	1,235,634.45	5.46
64	002405	四维图新	1,212,458.00	5.36
65	300011	鼎汉技术	1,209,399.01	5.35
66	603019	中科曙光	1,197,063.00	5.29
67	300136	信维通信	1,183,096.43	5.23
68	300007	汉威电子	1,168,972.00	5.17
69	600702	沱牌舍得	1,117,550.00	4.94
70	002335	科华恒盛	1,104,264.00	4.88
71	002367	康力电梯	1,080,411.00	4.78
72	002533	金杯电工	1,080,268.00	4.78
73	000651	格力电器	1,073,630.00	4.75
74	002041	登海种业	1,071,689.00	4.74
75	002034	美欣达	1,053,377.00	4.66
76	300382	斯莱克	1,016,498.00	4.49
77	000333	美的集团	1,007,479.00	4.45
78	002340	格林美	967,450.00	4.28
79	002414	高德红外	961,787.68	4.25
80	002631	德尔未来	950,809.00	4.20
81	300100	双林股份	941,231.18	4.16
82	002008	大族激光	925,694.00	4.09
83	000887	中鼎股份	918,529.26	4.06
84	300269	联建光电	907,531.00	4.01
85	300351	永贵电器	898,274.00	3.97
86	601233	桐昆股份	897,545.18	3.97
87	600987	航民股份	896,678.40	3.96
88	002444	巨星科技	888,955.00	3.93
89	002670	国盛金控	888,214.00	3.93
90	600990	四创电子	874,815.00	3.87
91	600699	均胜电子	846,420.00	3.74
92	002454	松芝股份	845,697.96	3.74
93	002094	青岛金王	844,165.00	3.73
94	603000	人民网	842,837.00	3.73

95	000400	许继电气	824,822.06	3.65
96	300088	长信科技	817,885.70	3.62
97	300302	同有科技	815,983.00	3.61
98	600999	招商证券	792,170.00	3.50
99	600754	锦江股份	791,305.48	3.50
100	600273	嘉化能源	788,163.95	3.48
101	601668	中国建筑	786,720.00	3.48
102	000983	西山煤电	784,310.85	3.47
103	000776	广发证券	783,476.00	3.46
104	000028	国药一致	776,410.00	3.43
105	002327	富安娜	775,642.76	3.43
106	600661	新南洋	771,557.00	3.41
107	300237	美晨科技	769,610.00	3.40
108	002372	伟星新材	768,653.40	3.40
109	300292	吴通控股	765,948.48	3.39
110	601199	江南水务	764,836.00	3.38
111	600109	国金证券	764,405.00	3.38
112	601899	紫金矿业	759,143.00	3.36
113	002172	澳洋科技	756,241.00	3.34
114	600978	宜华生活	756,000.00	3.34
115	600777	新潮能源	753,989.00	3.33
116	002007	华兰生物	753,212.00	3.33
117	300383	光环新网	751,246.00	3.32
118	600887	伊利股份	750,540.00	3.32
119	002303	美盈森	747,145.02	3.30
120	600756	浪潮软件	741,161.00	3.28
121	600867	通化东宝	740,895.20	3.28
122	002475	立讯精密	733,103.00	3.24
123	600567	山鹰纸业	732,000.00	3.24
124	600803	新奥股份	731,410.00	3.23
125	601006	大秦铁路	730,000.00	3.23
126	603589	口子窖	729,020.00	3.22
127	601997	贵阳银行	727,260.00	3.22
128	000063	中兴通讯	726,680.00	3.21
129	002037	久联发展	725,655.21	3.21
130	601555	东吴证券	725,549.00	3.21
131	000636	风华高科	725,082.00	3.21
132	000783	长江证券	724,200.00	3.20

133	600958	东方证券	720,000.00	3.18
134	600418	江淮汽车	719,820.00	3.18
135	601766	中国中车	711,850.00	3.15
136	600826	兰生股份	708,744.64	3.13
137	000049	德赛电池	708,150.98	3.13
138	000671	阳光城	707,210.00	3.13
139	002127	南极电商	704,978.09	3.12
140	600643	爱建集团	701,419.00	3.10
141	300367	东方网力	700,591.00	3.10
142	000070	特发信息	699,718.00	3.09
143	002001	新和成	698,326.00	3.09
144	300014	亿纬锂能	696,833.00	3.08
145	002241	歌尔股份	693,600.00	3.07
146	002410	广联达	692,211.00	3.06
147	603993	洛阳钼业	690,704.00	3.05
148	000498	山东路桥	689,000.00	3.05
149	300090	盛运环保	685,878.00	3.03
150	000716	黑芝麻	684,555.00	3.03
151	600259	广晟有色	682,757.00	3.02
152	000858	五粮液	681,012.27	3.01
153	600332	白云山	678,900.00	3.00
154	000799	酒鬼酒	678,816.00	3.00
155	000807	云铝股份	678,716.19	3.00
156	000568	泸州老窖	678,234.00	3.00
157	600362	江西铜业	673,440.00	2.98
158	002024	苏宁云商	672,640.00	2.97
159	000598	兴蓉环境	670,879.00	2.97
160	600977	中国电影	669,760.00	2.96
161	000554	泰山石油	668,727.50	2.96
162	600006	东风汽车	666,489.00	2.95
163	300287	飞利信	661,763.00	2.93
164	300129	泰胜风能	661,156.22	2.92
165	002310	东方园林	660,800.00	2.92
166	002321	华英农业	660,604.00	2.92
167	601800	中国交建	658,220.00	2.91
168	601801	皖新传媒	658,144.11	2.91
169	000915	山大华特	657,404.00	2.91
170	002440	闰土股份	655,500.00	2.90

171	600278	东方创业	654,240.00	2.89
172	300043	星辉娱乐	651,764.32	2.88
173	002280	联络互动	650,400.00	2.88
174	601636	旗滨集团	649,500.00	2.87
175	000596	古井贡酒	647,148.00	2.86
176	002292	奥飞娱乐	646,937.01	2.86
177	600168	武汉控股	644,393.00	2.85
178	600270	外运发展	643,837.00	2.85
179	000404	华意压缩	643,500.00	2.85
180	601377	兴业证券	642,400.00	2.84
181	300115	长盈精密	638,834.00	2.82
182	002242	九阳股份	638,355.00	2.82
183	603766	隆鑫通用	636,659.00	2.81
184	600963	岳阳林纸	635,483.00	2.81
185	000100	TCL 集团	631,800.00	2.79
186	002730	电光科技	630,265.00	2.79
187	600667	太极实业	628,264.38	2.78
188	000970	中科三环	621,378.11	2.75
189	002281	光迅科技	621,210.00	2.75
190	600626	申达股份	615,840.00	2.72
191	600500	中化国际	615,680.00	2.72
192	300364	中文在线	612,866.50	2.71
193	600525	长园集团	598,220.20	2.64
194	000039	中集集团	593,330.00	2.62
195	002439	启明星辰	577,127.00	2.55
196	600146	商赢环球	571,864.24	2.53
197	002196	方正电机	558,029.00	2.47
198	002050	三花智控	538,569.52	2.38
199	603899	晨光文具	536,245.00	2.37
200	300379	东方通	521,770.00	2.31
201	002081	金螳螂	515,500.00	2.28
202	002445	中南文化	490,250.00	2.17
203	600108	亚盛集团	470,370.00	2.08
204	002456	欧菲光	470,273.00	2.08

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。

8.2.3 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	199,375,589.80
卖出股票收入（成交）总额	224,006,128.19

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。

8.3 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。

8.4 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。

8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.8.1 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。

8.8.2 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。

8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.9.3 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。

8.10 投资组合报告附注

8.10.1

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。

8.10.2

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。

8.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	117,914.59
2	应收证券清算款	786,921.40
3	应收股利	—
4	应收利息	880.33
5	应收申购款	2,456.32
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	908,172.64

8.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000887	中鼎股份	726,320.00	3.21	重大事项停牌

8.10.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 投资组合报告（转型前）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	44,604,001.30	89.02
	其中：股票	44,604,001.30	89.02
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	4,374,372.42	8.73
7	其他资产	1,124,937.51	2.25
8	合计	50,103,311.23	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	1,473,390.00	3.03
C	制造业	19,862,787.22	40.90
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	1,192,500.00	2.46
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,025,740.00	16.53
J	金融业	7,371,000.00	15.18
K	房地产业	—	—

L	租赁和商务服务业	1,305,000.00	2.69
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,373,584.08	11.06
S	综合	-	-
	合计	44,604,001.30	91.84

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	300133	华策影视	100,937	1,598,842.08	3.29
2	300336	新文化	65,000	1,595,100.00	3.28
3	600576	万家文化	70,200	1,559,142.00	3.21
4	002271	东方雨虹	75,000	1,416,750.00	2.92
5	300031	宝通科技	55,000	1,368,400.00	2.82
6	601198	东兴证券	55,000	1,349,700.00	2.78
7	300078	思创医惠	40,000	1,340,000.00	2.76
8	601688	华泰证券	65,000	1,331,850.00	2.74
9	600584	长电科技	65,000	1,331,200.00	2.74
10	002707	众信旅游	60,000	1,305,000.00	2.69
11	600651	飞乐音响	100,000	1,280,000.00	2.64
12	002131	利欧股份	70,000	1,276,800.00	2.63
13	300007	汉威电子	45,000	1,232,550.00	2.54
14	603019	中科曙光	30,000	1,198,200.00	2.47
15	002245	澳洋顺昌	90,000	1,192,500.00	2.46
16	002335	科华恒盛	24,000	1,158,480.00	2.39
17	601788	光大证券	65,000	1,145,950.00	2.36
18	002048	宁波华翔	50,000	1,131,000.00	2.33
19	002405	四维图新	45,000	1,114,200.00	2.29

20	600061	国投安信	60,000	1,086,000.00	2.24
21	002034	美欣达	28,000	1,057,280.00	2.18
22	002517	恺英网络	22,000	1,007,820.00	2.08
23	002500	山西证券	60,000	995,400.00	2.05
24	300033	同花顺	12,000	993,000.00	2.04
25	603008	喜临门	57,000	991,230.00	2.04
26	002413	雷科防务	65,000	968,500.00	1.99
27	002414	高德红外	35,000	957,250.00	1.97
28	002444	巨星科技	45,000	944,100.00	1.94
29	300269	联建光电	35,000	908,950.00	1.87
30	600990	四创电子	10,000	904,100.00	1.86
31	300369	绿盟科技	20,000	845,400.00	1.74
32	002094	青岛金王	30,000	799,800.00	1.65
33	300302	同有科技	23,000	797,640.00	1.64
34	002673	西部证券	30,000	773,100.00	1.59
35	300292	吴通控股	19,401	760,907.22	1.57
36	600547	山东黄金	17,000	742,390.00	1.53
37	603993	洛阳钼业	170,000	731,000.00	1.51
38	601555	东吴证券	50,000	689,000.00	1.42
39	300144	宋城演艺	25,000	620,500.00	1.28
40	300100	双林股份	14,000	603,540.00	1.24
41	002280	联络互动	30,000	591,300.00	1.22
42	002445	中南文化	25,000	574,750.00	1.18
43	002345	潮宏基	30,000	304,200.00	0.63
44	300518	盛讯达	500	31,180.00	0.06

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300133	华策影视	4,295,617.66	13.02
2	002007	华兰生物	3,722,030.60	11.28
3	300017	网宿科技	3,709,181.90	11.25
4	300059	东方财富	3,631,509.00	11.01
5	002517	恺英网络	3,549,579.76	10.76
6	600612	老凤祥	3,419,776.75	10.37

7	300078	思创医惠	3,400,152.00	10.31
8	300207	欣旺达	3,055,592.31	9.26
9	300033	同花顺	3,054,147.60	9.26
10	300031	宝通科技	3,042,761.00	9.22
11	601198	东兴证券	2,853,043.00	8.65
12	600756	浪潮软件	2,702,780.18	8.19
13	002271	东方雨虹	2,527,372.00	7.66
14	600597	光明乳业	2,497,379.50	7.57
15	002117	东港股份	2,489,899.06	7.55
16	002445	中南文化	2,366,390.00	7.17
17	600651	飞乐音响	2,348,698.00	7.12
18	300232	洲明科技	2,268,044.72	6.88
19	600562	国睿科技	2,252,066.00	6.83
20	002340	格林美	2,235,972.00	6.78
21	002172	澳洋科技	2,213,557.54	6.71
22	002368	太极股份	2,172,576.00	6.59
23	002303	美盈森	2,090,231.00	6.34
24	300302	同有科技	2,046,169.20	6.20
25	002311	海大集团	2,005,208.92	6.08
26	600584	长电科技	1,993,183.00	6.04
27	601688	华泰证券	1,974,800.00	5.99
28	300367	东方网力	1,969,426.00	5.97
29	600547	山东黄金	1,946,166.83	5.90
30	002253	川大智胜	1,893,111.00	5.74
31	300242	明家联合	1,885,095.48	5.72
32	002405	四维图新	1,871,043.29	5.67
33	002041	登海种业	1,855,479.00	5.63
34	601788	光大证券	1,821,373.00	5.52
35	300009	安科生物	1,816,111.00	5.51
36	002165	红宝丽	1,810,643.00	5.49
37	300269	联建光电	1,804,848.10	5.47
38	002131	利欧股份	1,754,013.44	5.32
39	601069	西部黄金	1,750,324.50	5.31
40	300113	顺网科技	1,729,748.00	5.24
41	300146	汤臣倍健	1,670,742.00	5.07
42	002329	皇氏集团	1,645,287.00	4.99

43	603008	喜临门	1,631,183.00	4.95
44	300336	新文化	1,627,680.74	4.93
45	002730	电光科技	1,624,018.00	4.92
46	600061	国投安信	1,597,551.00	4.84
47	600073	上海梅林	1,592,853.33	4.83
48	000423	东阿阿胶	1,590,412.00	4.82
49	002707	众信旅游	1,588,820.00	4.82
50	002673	西部证券	1,552,274.00	4.71
51	000799	酒鬼酒	1,552,260.00	4.71
52	002664	信质电机	1,550,614.94	4.70
53	603686	龙马环卫	1,532,884.00	4.65
54	600867	通化东宝	1,520,933.76	4.61
55	002048	宁波华翔	1,478,017.00	4.48
56	600409	三友化工	1,465,286.00	4.44
57	000028	国药一致	1,446,407.00	4.39
58	603019	中科曙光	1,440,084.00	4.37
59	000700	模塑科技	1,439,783.05	4.37
60	000488	晨鸣纸业	1,417,346.00	4.30
61	002548	金新农	1,414,999.00	4.29
62	600884	杉杉股份	1,401,337.99	4.25
63	600967	北方创业	1,386,300.00	4.20
64	600576	万家文化	1,377,215.00	4.18
65	600195	中牧股份	1,376,562.80	4.17
66	002078	太阳纸业	1,363,773.00	4.13
67	300408	三环集团	1,355,460.00	4.11
68	300011	鼎汉技术	1,350,995.78	4.10
69	002712	思美传媒	1,279,333.15	3.88
70	002074	国轩高科	1,257,552.00	3.81
71	002245	澳洋顺昌	1,253,996.21	3.80
72	300100	双林股份	1,246,866.00	3.78
73	601233	桐昆股份	1,227,202.00	3.72
74	600436	片仔癀	1,221,704.00	3.70
75	002572	索菲亚	1,212,543.00	3.68
76	600702	沱牌舍得	1,203,452.00	3.65
77	300007	汉威电子	1,196,669.00	3.63
78	002533	金杯电工	1,187,309.00	3.60

79	002335	科华恒盛	1,171,368.00	3.55
80	002631	德尔未来	1,170,278.00	3.55
81	002325	洪涛股份	1,161,244.00	3.52
82	600667	太极实业	1,136,197.00	3.44
83	000418	小天鹅 A	1,121,181.00	3.40
84	300224	正海磁材	1,109,655.00	3.36
85	300296	利亚德	1,107,674.55	3.36
86	002385	大北农	1,102,700.00	3.34
87	002367	康力电梯	1,102,485.56	3.34
88	000960	锡业股份	1,089,926.00	3.30
89	002034	美欣达	1,050,148.00	3.18
90	002500	山西证券	1,027,934.00	3.12
91	002280	联络互动	1,023,700.80	3.10
92	002413	雷科防务	994,875.20	3.02
93	002268	卫士通	977,195.00	2.96
94	002444	巨星科技	931,800.00	2.82
95	600990	四创电子	915,235.00	2.77
96	601689	拓普集团	911,083.00	2.76
97	002260	德奥通航	908,390.00	2.75
98	000733	振华科技	895,405.00	2.71
99	002414	高德红外	891,087.00	2.70
100	601777	力帆股份	888,140.00	2.69
101	300144	宋城演艺	886,212.58	2.69
102	600711	盛屯矿业	873,668.00	2.65
103	300369	绿盟科技	857,865.44	2.60
104	000333	美的集团	854,456.00	2.59
105	002358	森源电气	853,030.00	2.59
106	002308	威创股份	846,529.00	2.57
107	601799	星宇股份	840,112.00	2.55
108	300065	海兰信	836,730.00	2.54
109	603000	人民网	834,007.98	2.53
110	000887	中鼎股份	824,042.00	2.50
111	600718	东软集团	820,539.00	2.49
112	600340	华夏幸福	816,444.00	2.48
113	002454	松芝股份	812,058.00	2.46
114	600754	锦江股份	811,432.00	2.46

115	000726	鲁泰 A	804,968.00	2.44
116	002094	青岛金王	799,684.00	2.42
117	300383	光环新网	793,295.00	2.41
118	002327	富安娜	785,162.00	2.38
119	300251	光线传媒	784,769.00	2.38
120	600501	航天晨光	781,344.00	2.37
121	603799	华友钴业	770,890.00	2.34
122	300285	国瓷材料	769,117.50	2.33
123	600690	青岛海尔	764,019.00	2.32
124	000801	四川九洲	759,900.00	2.30
125	603993	洛阳钼业	753,270.00	2.28
126	002488	金固股份	748,942.00	2.27
127	600276	恒瑞医药	747,777.50	2.27
128	603609	禾丰牧业	745,874.60	2.26
129	002425	凯撒文化	742,846.00	2.25
130	300291	华录百纳	741,590.00	2.25
131	600366	宁波韵升	732,160.00	2.22
132	600730	中国高科	732,127.00	2.22
133	600685	中船防务	729,886.00	2.21
134	000558	莱茵体育	722,489.00	2.19
135	000876	新希望	719,188.00	2.18
136	002196	方正电机	717,777.00	2.18
137	002659	中泰桥梁	716,205.00	2.17
138	600172	黄河旋风	712,959.34	2.16
139	002092	中泰化学	712,250.00	2.16
140	000625	长安汽车	707,784.00	2.15
141	000063	中兴通讯	704,640.00	2.14
142	000501	鄂武商 A	704,157.00	2.13
143	603806	福斯特	702,113.00	2.13
144	300047	天源迪科	701,628.00	2.13
145	002103	广博股份	700,124.00	2.12
146	000938	紫光股份	700,000.00	2.12
147	002188	巴士在线	697,526.35	2.11
148	002294	信立泰	696,063.00	2.11
149	000596	古井贡酒	691,425.00	2.10
150	000568	泸州老窖	689,040.00	2.09

151	600332	白云山	687,530.00	2.08
152	002123	梦网荣信	687,250.00	2.08
153	300385	雪浪环境	680,660.00	2.06
154	002292	奥飞娱乐	679,680.00	2.06
155	300364	中文在线	677,974.00	2.06
156	601628	中国人寿	675,574.00	2.05
157	002281	光迅科技	674,548.20	2.05
158	601555	东吴证券	674,500.00	2.04
159	300089	文化长城	670,288.96	2.03
160	002456	欧菲光	666,027.00	2.02
161	002587	奥拓电子	665,423.00	2.02
162	600525	长园集团	662,960.00	2.01
163	600138	中青旅	661,288.00	2.00

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300017	网宿科技	3,794,816.71	11.50
2	300059	东方财富	3,578,194.20	10.85
3	002007	华兰生物	3,113,739.46	9.44
4	300207	欣旺达	2,900,540.10	8.79
5	600612	老凤祥	2,716,864.79	8.24
6	002117	东港股份	2,698,868.00	8.18
7	600756	浪潮软件	2,663,354.50	8.07
8	002445	中南文化	2,597,947.00	7.88
9	300232	洲明科技	2,453,382.00	7.44
10	600562	国睿科技	2,282,897.00	6.92
11	300133	华策影视	2,187,866.40	6.63
12	002368	太极股份	2,042,219.50	6.19
13	300242	明家联合	2,031,767.50	6.16
14	002303	美盈森	2,024,900.46	6.14
15	002172	澳洋科技	2,006,752.00	6.08
16	300033	同花顺	2,004,483.25	6.08
17	002311	海大集团	1,970,221.93	5.97
18	002517	恺英网络	1,957,819.76	5.94

19	600651	飞乐音响	1,946,101.00	5.90
20	002253	川大智胜	1,906,295.46	5.78
21	300009	安科生物	1,899,571.54	5.76
22	002165	红宝丽	1,860,501.55	5.64
23	300113	顺网科技	1,847,438.00	5.60
24	600754	锦江股份	1,827,054.00	5.54
25	002041	登海种业	1,807,989.00	5.48
26	300078	思创医惠	1,774,747.00	5.38
27	002329	皇氏集团	1,741,308.00	5.28
28	601069	西部黄金	1,682,648.33	5.10
29	300031	宝通科技	1,660,728.00	5.03
30	002664	信质电机	1,644,984.00	4.99
31	002572	索菲亚	1,618,695.00	4.91
32	002730	电光科技	1,613,218.93	4.89
33	002325	洪涛股份	1,605,467.00	4.87
34	600718	东软集团	1,587,170.00	4.81
35	603686	龙马环卫	1,579,313.00	4.79
36	300146	汤臣倍健	1,578,199.00	4.78
37	601198	东兴证券	1,525,691.00	4.63
38	002548	金新农	1,502,585.54	4.56
39	002712	思美传媒	1,461,845.00	4.43
40	002033	丽江旅游	1,451,344.00	4.40
41	600547	山东黄金	1,442,900.00	4.37
42	000700	模塑科技	1,432,247.00	4.34
43	600884	杉杉股份	1,424,776.00	4.32
44	300144	宋城演艺	1,412,118.00	4.28
45	603008	喜临门	1,408,345.20	4.27
46	600340	华夏幸福	1,405,606.36	4.26
47	600967	北方创业	1,372,364.88	4.16
48	600195	中牧股份	1,370,742.04	4.16
49	300011	鼎汉技术	1,311,542.00	3.98
50	300302	同有科技	1,304,745.10	3.96
51	300450	先导智能	1,298,885.00	3.94
52	002605	姚记扑克	1,284,840.00	3.90
53	002587	奥拓电子	1,239,907.48	3.76
54	600597	光明乳业	1,210,583.00	3.67
55	002340	格林美	1,198,200.36	3.63
56	600667	太极实业	1,190,149.00	3.61

57	300408	三环集团	1,187,102.00	3.60
58	601233	桐昆股份	1,183,085.75	3.59
59	300296	利亚德	1,161,682.48	3.52
60	002574	明牌珠宝	1,158,858.00	3.51
61	000960	锡业股份	1,151,890.00	3.49
62	300224	正海磁材	1,143,488.00	3.47
63	002385	大北农	1,136,885.00	3.45
64	000418	小天鹅 A	1,129,930.90	3.43
65	002631	德尔未来	1,119,649.00	3.39
66	300367	东方网力	1,107,749.24	3.36
67	002405	四维图新	1,083,614.00	3.29
68	600895	张江高科	1,046,125.00	3.17
69	300269	联建光电	1,010,282.33	3.06
70	601689	拓普集团	996,950.00	3.02
71	600730	中国高科	961,855.48	2.92
72	002268	卫士通	955,914.00	2.90
73	601777	力帆股份	927,346.00	2.81
74	600576	万家文化	882,569.00	2.68
75	300251	光线传媒	865,597.00	2.62
76	601799	星宇股份	862,966.00	2.62
77	002260	德奥通航	860,533.60	2.61
78	000733	振华科技	841,130.81	2.55
79	002308	威创股份	830,781.00	2.52
80	000799	酒鬼酒	820,084.54	2.49
81	002188	巴士在线	806,024.68	2.44
82	603806	福斯特	803,445.00	2.44
83	002292	奥飞娱乐	801,469.00	2.43
84	300285	国瓷材料	794,691.00	2.41
85	300047	天源迪科	784,964.47	2.38
86	300499	高澜股份	783,865.00	2.38
87	600867	通化东宝	780,368.00	2.37
88	000726	鲁泰 A	771,777.89	2.34
89	300291	华录百纳	766,482.00	2.32
90	603766	隆鑫通用	763,439.00	2.31
91	603609	禾丰牧业	763,117.00	2.31
92	600501	航天晨光	760,000.00	2.30
93	600276	恒瑞医药	750,282.50	2.27
94	002092	中泰化学	744,800.00	2.26

95	002659	中泰桥梁	737,391.00	2.24
96	600172	黄河旋风	737,290.00	2.24
97	000423	东阿阿胶	736,000.00	2.23
98	600146	商赢环球	730,236.00	2.21
99	000876	新希望	728,010.00	2.21
100	002196	方正电机	726,029.00	2.20
101	000558	莱茵体育	703,720.00	2.13
102	600366	宁波韵升	703,221.00	2.13
103	603019	中科曙光	702,351.00	2.13
104	000970	中科三环	702,220.55	2.13
105	603799	华友钴业	701,356.00	2.13
106	000028	国药一致	697,938.02	2.12
107	002200	云投生态	684,888.00	2.08
108	300027	华谊兄弟	678,196.80	2.06
109	300100	双林股份	677,005.00	2.05
110	600138	中青旅	675,336.00	2.05
111	002294	信立泰	674,713.00	2.05
112	600584	长电科技	666,891.00	2.02
113	300014	亿纬锂能	665,265.36	2.02
114	000938	紫光股份	664,000.00	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。

8.4.3 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	215,301,629.69
卖出股票收入（成交）总额	195,188,258.83

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。

8.5 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。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

2016 年 1 月 13 日，中国证监会四川监管局作出《关于对东兴证券股份有限公司采取监管谈话措施的决定》（[2016]3 号），认定 2015 年 7 月 30 日至 9 月 30 日之间，“15 龙投债”发行人龙泉现代新增借款达到《募集说明书》约定的披露标准但未披露，东兴证券股份有限公司未按照《债券受托管理协议》约定督促发行人及时履行信息披露义务，对公司采取监管谈话措施，并要求提交书面整改报告。

华泰证券股份有限公司因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，于 2016 年 11 月 28 日收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]128 号）。

本基金的投资决策程序符合相关法律法规及公司内部制度。

8.12.2

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。

8.12.3 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	119,503.54
2	应收证券清算款	997,272.26
3	应收股利	—
4	应收利息	8,062.90
5	应收申购款	98.81
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,124,937.51

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600576	万家文化	1,559,142.00	3.21	重大事项停牌

8.12.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息（转型后）**9.3 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
781	20,542.81	227,288.83	1.42%	15,816,648.86	98.58%

9.4 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	46,613.47	0.29%

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0~10；

（2）该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0~10。

9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
729	39,079.97	12,089,051.25	42.43%	16,400,245.90	57.57%

9.2 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	12,742.64	0.04%

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

(2) 该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0~10。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	28,489,297.15
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,059,924.78
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	13,505,284.24
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	16,043,937.69

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	524,890,436.66
本报告期期初基金份额总额	16,962,384.30
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	18,366,237.22
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	6,839,324.37
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	28,489,297.15

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2016 年 6 月 20 日至 2016 年 7 月 5 日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议了《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》。基金管理人于 2016 年 7 月 6

日在监督人、公证员的现场监督及律师的现场见证下，统计了本次基金份额持有人大会的表决结果。表决结果详见 2016 年 7 月 8 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及天治基金管理有限公司网站（www.chinanature.com.cn）上发布的《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》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令【第 104 号】）的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本次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》，本次大会决议自该日起生效。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，经天治基金管理有限公司董事会审议通过，聘任吕文龙先生担任公司董事长职务。上述事项已按有关规定报中国基金业协会、中国证券监督管理委员会上海监管局备案，本基金管理人 2016 年 6 月 21 日在指定媒体及公司网站上刊登了《天治基金管理有限公司关于董事长变更的公告》。

2016 年 10 月，许卿斌先生担任上海银行股份有限公司资产托管部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

转型后，本基金的投资策略为采用“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。

转型前，本基金的投资策略为综合运用灵活而有纪律的资产配置策略和精选证券策略。在组合构建上，本基金采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”股票投资策略相结合的方式。通过精选持续性成长、趋势性成长和周期性成长股票，不断优化组合，追求稳定的资本增值。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来，未变更过会计师事务所。

本报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 4 万元整。目前的审计机构—安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已提供审计服务的连续年限为自 2011 年 8 月 4 日（原基金合同生效日）至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	257,249,694.76	61.13%	234,432.33	60.61%	-
东方证券	1	157,659,364.14	37.46%	146,828.12	37.96%	-
国信证券	1	5,924,823.00	1.41%	5,517.86	1.43%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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

2、基金专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

3、本基金本报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	2,500,000.00	100.00%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	283,064,360.84	68.96%	257,956.93	68.50%	-
东方证券	1	125,677,432.68	30.62%	117,043.28	31.08%	-
国信证券	1	1,720,400.00	0.42%	1,602.15	0.43%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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

2、基金专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

3、本基金本报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	41,400.80	100.00%	25,000,000.00	100.00%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天治基金管理有限公司关于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	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 7 月 8 日
2	天治基金管理有限公司关于成长精选混合型证券投资基金名称变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 7 月 8 日
3	天治新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 7 月 8 日
4	天治新消费灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 7 月 8 日
5	天治新消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 7 月 8 日
6	天治成长精选混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 7 月 19 日

7	天治基金管理有限公司关于旗下基金增加大泰金石为代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 8 月 17 日
8	天治基金管理有限公司关于旗下基金增加金观诚为代销机构、开通定期定额投资业务和基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 8 月 24 日
9	天治基金管理有限公司更正公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 8 月 27 日
10	天治成长精选混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 8 月 29 日
11	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	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 9 月 20 日
12	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加钱景财富为代销机构、开通定期定额投资业务和基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 9 月 28 日
13	天治成长精选混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 10 月 26 日
14	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	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 11 月 29 日

	续费率优惠活动的公告		
15	天治基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 12 月 8 日
16	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持长信科技、万家文化股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 12 月 14 日
17	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	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 12 月 22 日
18	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2017 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 12 月 29 日
19	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 12 月 29 日
20	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 12 月 30 日

11.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天治基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断调整	中国证券报、上海证券报、证券时报及公	2016 年 1 月 4 日

	旗下基金相关业务办理时间的公告	司官网	
2	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持万科 A 股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 1 月 6 日
3	天治基金关于指数熔断期间暂停申购赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 1 月 6 日
4	《天治基金关于旗下部分开放式基金参加同花顺基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 1 月 6 日
5	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持文化长城、梅泰诺、朗姿股份股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 1 月 7 日
6	天治基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 1 月 7 日
7	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持明家科技、光环新网股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 1 月 9 日
8	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持凯撒旅游股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 1 月 12 日
9	天治成长精选混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 1 月 22 日
10	天治基金管理有限公司关于调	中国证券报、上海证	2016 年 1 月 30 日

	整旗下基金所持吴通控股、陆家嘴股票估值方法的公告	券报、证券时报及公司官网	
11	天治基金管理有限公司关于基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 2 月 3 日
12	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持金叶珠宝股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 2 月 6 日
13	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持中茵股份股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 2 月 24 日
14	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持通源石油股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 2 月 25 日
15	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持中南重工股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 3 月 2 日
16	天治成长精选混合型证券投资基金更新的招募说明书(摘要)(2016 年第 1 次更新)	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 3 月 18 日
17	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持姚记扑克股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 3 月 25 日
18	天治成长精选混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 3 月 30 日
19	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持电光科技股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 4 月 1 日

20	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持广生堂股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 4 月 8 日
21	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持万家文化股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 4 月 16 日
22	天治成长精选混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 4 月 21 日
23	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持华灿光电股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 4 月 22 日
24	关于天治基金公司淘宝店关闭申购服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 5 月 5 日
25	关于天治基金公司网上交易支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 5 月 5 日
26	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持恒锋工具股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 5 月 6 日
27	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持康耐特股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 5 月 12 日
28	天治基金管理有限公司关于以通讯方式召开天治成长精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 5 月 25 日
29	天治基金管理有限公司关于以	中国证券报、上海证	2016 年 5 月 26 日

	通讯方式召开天治成长精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会第一次提示性公告	券报、证券时报及公司官网	
30	天治基金管理有限公司关于以通讯方式召开天治成长精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会第二次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 5 月 27 日
31	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持光一科技股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 6 月 3 日
32	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持兴民钢圈股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 6 月 4 日
33	天治基金管理有限公司关于在陆金所资管开通基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 6 月 8 日
34	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开展赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 6 月 16 日
35	天治基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 6 月 21 日
36	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金继续参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 6 月 24 日
37	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持苏交科股票估	中国证券报、上海证券报、证券时报及公	2016 年 6 月 29 日

	值方法的公告	司官网	
38	天治基金管理有限公司关于成长精选混合型证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司官网	2016 年 7 月 1 日

§ 12 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准天治新消费灵活配置混合型证券投资基金、天治成长精选混合型证券投资基金募集的文件
2. 《天治成长精选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基金合同》
3. 《天治成长精选混合型证券投资基金招募说明书》、《天治新消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
4. 《天治成长精选混合型证券投资基金托管协议》、《天治新消费灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
6. 报告期内天治新消费灵活配置混合型证券投资基金、天治成长精选混合型证券投资基金公告的各项原稿

13.2 存放地点

上海市复兴西路 159 号

13.3 查阅方式

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

天治基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日