

# 天治低碳经济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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	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）	9
2.3 基金管理人和基金托管人	9
2.4 信息披露方式	10
2.5 其他相关资料	10
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	10
3.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2 基金净值表现（转型后）	11
3.2 基金净值表现（转型前）	13
3.3 其他指标	错误！未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况	错误！未定义书签。
<b>§4 管理人报告</b>	15
4.1 基金管理人及基金经理情况	15
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	17
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	20
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	21
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	22
<b>§5 托管人报告</b>	22
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	22
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	22
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
<b>§6 审计报告（转型后）</b>	23
6.1 审计报告基本信息	23
6.2 审计报告的基本内容	23
<b>§6 审计报告（转型前）</b>	24
6.1 审计报告基本信息	24
6.2 审计报告的基本内容	24
<b>§7 年度财务报表（转型后）</b>	25
7.1 资产负债表（转型后）	25
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	28

<b>§7 年度财务报表（转型前）</b>	<b>51</b>
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	54
7.4 报表附注	55
<b>§8 投资组合报告（转型后）</b>	<b>77</b>
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	93
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	93
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	93
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	93
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	93
8.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	93
8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	94
8.10 投资组合报告附注	94
<b>§8 投资组合报告（转型前）</b>	<b>95</b>
8.1 期末基金资产组合情况	95
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	95
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	96
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	97
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	105
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	105
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	105
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	105
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	105
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	105
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	106
8.12 投资组合报告附注	106
<b>§9 基金份额持有人信息（转型后）</b>	<b>107</b>
9.3 期末基金份额持有人户数及持有人结构	107
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	107
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	107
<b>§9 基金份额持有人信息（转型前）</b>	<b>107</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	107
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	108
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	108
<b>§10 开放式基金份额变动(转型后)</b>	<b>108</b>
<b>§10 开放式基金份额变动(转型前)</b>	<b>108</b>
<b>§11 重大事件揭示</b>	<b>109</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	109
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	109
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	109

---

11.4 基金投资策略的改变 .....	109
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	110
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 .....	110
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后） .....	110
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前） .....	111
11.9 其他重大事件（转型后） .....	113
11.9 其他重大事件（转型前） .....	117
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>错误！未定义书签。</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>120</b>
13.1 备查文件目录 .....	120
13.2 存放地点 .....	120
13.3 查阅方式 .....	120

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	天治低碳经济混合
基金主代码	350002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 18 日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	45,570,944.31 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	天治品质优选混合型证券投资基金
基金简称	天治品质优选
基金主代码	350002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 1 月 12 日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	74,404,343.09 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，精选受益于低碳经济的主题相关企业，追求持续稳健的超额回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>资产配置策略方面，本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据宏观经济运行态势、政策变化、市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>本基金实施大类资产配置策略过程中还将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，动态优化投资组合，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>在全球气候变暖的背景下，以低能耗、低污染为基础的“低碳经济”成为全球热点。低碳经济是一种以低</p>

	<p>能耗、低污染、低排放为特点的发展模式,是以应对气候变化、保障能源安全、促进经济社会可持续发展有机结合为目的的新规则。本基金将沿着低碳经济的路线,把握其中蕴含的投资机会。</p> <p>(1) 低碳经济主题类股票的界定:</p> <p>本基金认可的低碳经济主题类股票包括两种类型的股票:</p> <p>1) 直接从事低碳经济主题相关行业的股票</p> <p>①清洁能源: 主要包括清洁能源的研发、生产与运营,如风能、太阳能、生物质能、水电及核电等; 也包括清洁能源的传输、服务等配套产业, 如特高压输电、智能电网等相关上市公司;</p> <p>②节能减排: 主要包括与节能技术和装备、节能产品及节能服务产业的相关上市公司, 如工业节能、建筑节能、汽车节能; 也包括化石能源减排, 如清洁燃煤、整体煤气化联合循环、碳捕获与封存等相关上市公司;</p> <p>③碳交易与陆地碳汇、海洋碳汇: 主要包括与清洁发展机制项目和农林产业减排增汇等相关的上市公司;</p> <p>④环保行业: 包括环保技术和设备、环保服务和资源利用等相关行业的上市公司;</p> <p>2) 受益于低碳经济主题的股票, 包括:</p> <p>①传统高耗能高污染行业中, 通过有效节能减排措施或污染治理措施, 实现能耗降低、污染改善, 从而实现产业升级, 相对同类公司受益的上市公司;</p> <p>②与低碳经济主题相关的服务行业</p> <p>③投资于低碳经济相关产业的上市公司;</p> <p>④因与低碳经济主题相关的产业结构升级、消费生活模式转变而受益的其他上市公司。</p> <p>未来, 由于经济增长方式转变、产业结构升级等因素, 从事或受益于上述投资主题的外延将会逐渐扩大, 本基金将视实际情况调整上述对低碳环保主题类股票的识别及认定。</p> <p>(2) 个股投资策略</p> <p>通过行业领先度和市场领先度的双重定量评价以及长期驱动因素和事件驱动因素的双重定性分析, 精选受益于低碳经济主题相关企业进行重点投资。</p> <p>行业领先度主要考察盈利能力、行业贡献度和主营业务显著度, 其中以盈利能力为主。盈利能力通过净资产收益率和毛利率并辅以经营性现金净流量和自由现金流量进行综合评估, 行业贡献度依据营业收入和营业利润在行业中占比进行衡量, 主营业务显著度通过主营行业或产品的营业收入占比和营业利润占比进行比较。</p> <p>市场领先度主要考察估值水平、流动性和机构认同度, 其中以估值水平为主。估值水平通过 PE、PS、PB、净</p>
--	--

	<p>利润增长率、营业收入增长率、PEG、PSG 等静态估值水平、动态估值水平、历史成长性、预期成长性指标以及综合估值水平与成长性的指标进行横向和纵向比较，流动性指标包括自由流通比例和日均换手率、日均交易额等交易活跃度指标，机构认同度是指外部研究机构对个股的成长性与价值的一致性预期。</p> <p>长期驱动因素主要考察主营业务前景、管理层能力、公司战略和治理结构。以上因素作为公司内生性成长的基础，是公司可持续性发展的保障。</p> <p>事件驱动因素主要考察公司是否存在兼并收购、投资项目、资产增值等基本面的正向变动。以上因素是公司外延式增长的体现，作为长期驱动因素分析的有效补充。</p> <p><b>3、债券投资策略</b></p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p><b>4、权证投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>5、资产支持证券投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>6、股指期货投资策略</b></p> <p>本基金在进行股指期货投资时，采用流动性好、交易</p>
--	--

	<p>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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中证内地低碳经济主题指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	在有效控制风险的前提下，追求中长期稳定且超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金以股票品种为主要投资标的，以自下而上的股票优选策略为主，辅以自上而下的类别资产配置、行业资产配置，并依托专业的管理经验和有效的风险预算管理，构建和动态调整投资组合，以追求基金资产的中长期稳定增值。
业绩比较基准	中信标普 300 指数×70%+中信国债指数×30%。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中风险水平适中的品种，在投资管理全过程中严格实施风险预算管理，在明确的风险预算目标范围内追求稳定的超额收益率。

## 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		中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵正中	罗菲菲
	联系电话	021-60371155	010-58560666
	电子邮箱	zhaozz@chinanature.com.cn	tgbfx.jdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话	400-098-4800 (免长途通话费用)、021-60374800		95568

传真	021-60374934	010-58560798
注册地址	上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	上海市复兴西路 159 号	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	200031	100031
法定代表人	赵玉彪	洪崎

## 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》
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（特殊普通合伙）	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2016 年 4 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-4,820,845.42
本期利润	-5,727,482.91
加权平均基金份额本期利润	-0.1257
本期加权平均净值利润率	-17.20%
本期基金份额净值增长率	-14.87%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2016 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	-14,779,953.41
期末可供分配基金份额利润	-0.3243
期末基金资产净值	30,790,990.90
期末基金份额净值	0.6757
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2016 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	-14.87%

转型前

金额单位：人民币元

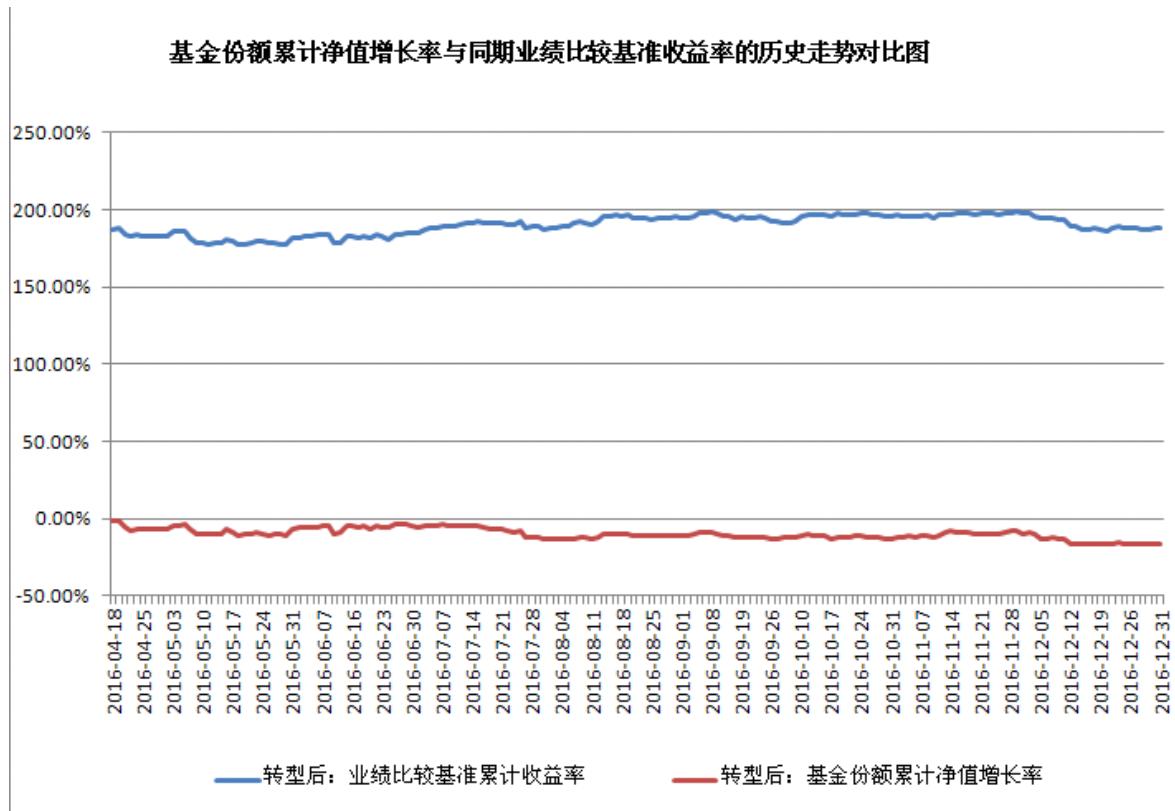
3.1.1 期间数据和指标	2016年1月1日至 2016年4月17日	2015年	2014年
本期已实现收益	-7,219,795.31	24,644,647.23	3,680,049.60
本期利润	-9,077,320.77	17,946,837.01	11,487,536.26
加权平均基金份额本期利润	-0.1838	0.3233	0.1155
本期加权平均净值利润率	-22.81%	29.17%	14.39%
本期基金份额净值增长率	-20.96%	7.50%	15.76%
3.1.2 期末数据和指标	2016年4月17日	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	-14,412,180.60	889,308.58	-4,379,600.82
期末可供分配基金份额利润	-0.1937	0.0202	-0.0510
期末基金资产净值	59,992,162.49	44,845,746.80	81,453,317.70
期末基金份额净值	0.8063	1.0202	0.9490
3.1.3 累计期末指标	2016年4月17日	2015年末	2014年末
基金份额累计净值增长率	185.61%	261.33%	236.11%

## 3.2 基金净值表现（转型后）

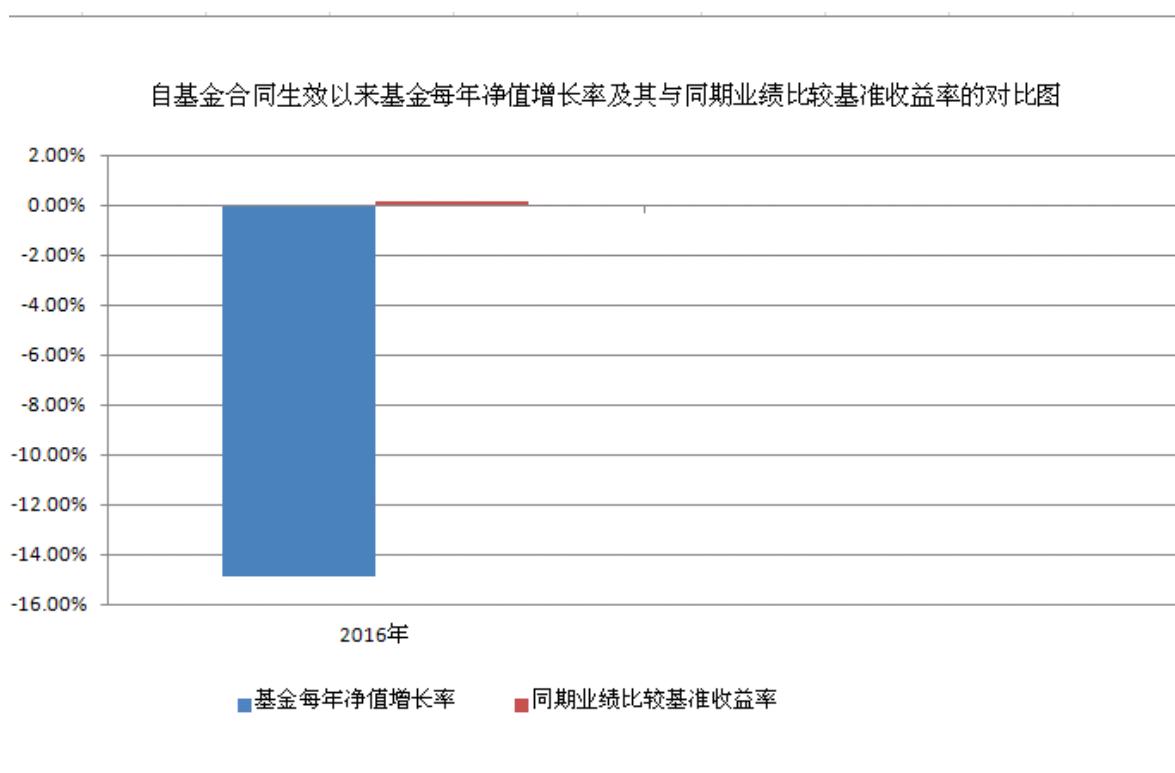
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-4.70%	1.06%	-1.59%	0.37%	-3.11%	0.69%
过去六个月	-11.81%	1.02%	1.05%	0.40%	-12.86%	0.62%
自基金合同生效起至今	-14.87%	1.29%	0.11%	0.49%	-14.98%	0.80%

### 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



注：本基金于 2016 年 4 月 18 日转型成立，本图所列基金合同生效当年的净值增长率，系按当年实际存续期计算。

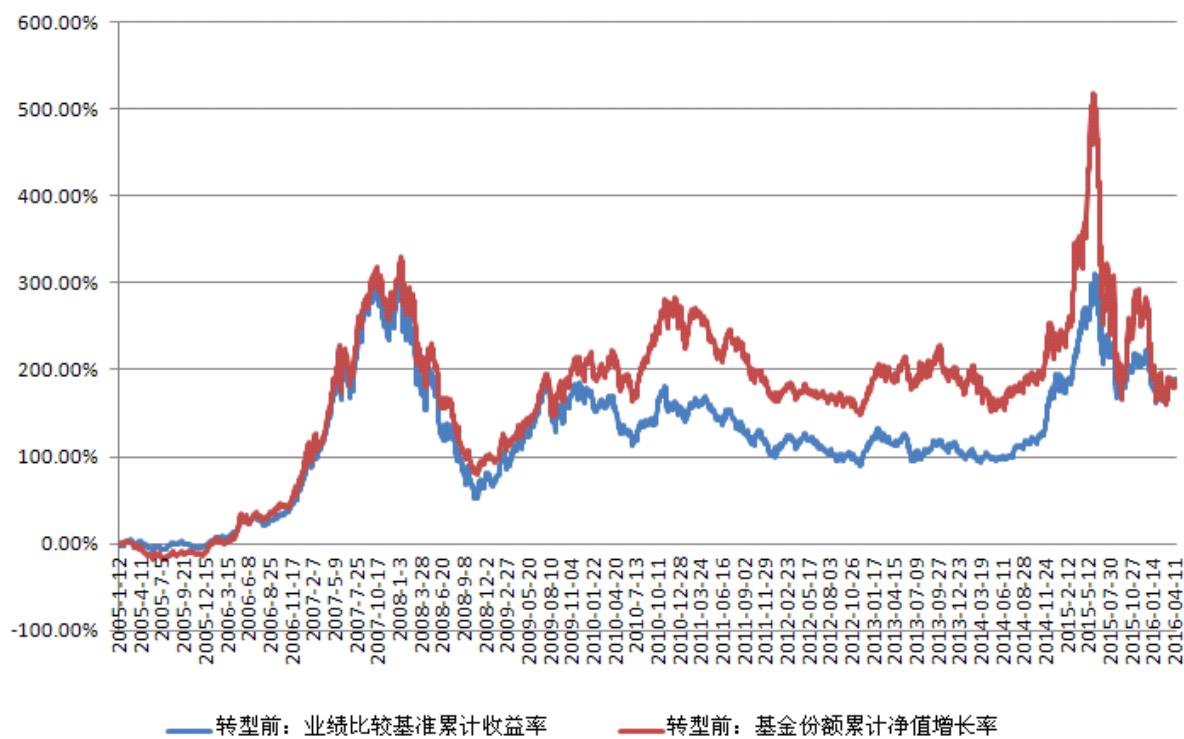
### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 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	-3.89%	2.18%	1.43%	1.34%	-5.32%	0.84%
过去六个 月	-11.46%	2.49%	-1.33%	1.41%	-10.13%	1.08%
过去一年	-36.65%	3.13%	-16.59%	1.89%	-20.06%	1.24%
过去三年	-1.14%	2.21%	34.99%	1.38%	-36.13%	0.83%
自基金合 同生效起 至今	185.61%	1.67%	188.95%	1.45%	-3.34%	0.22%

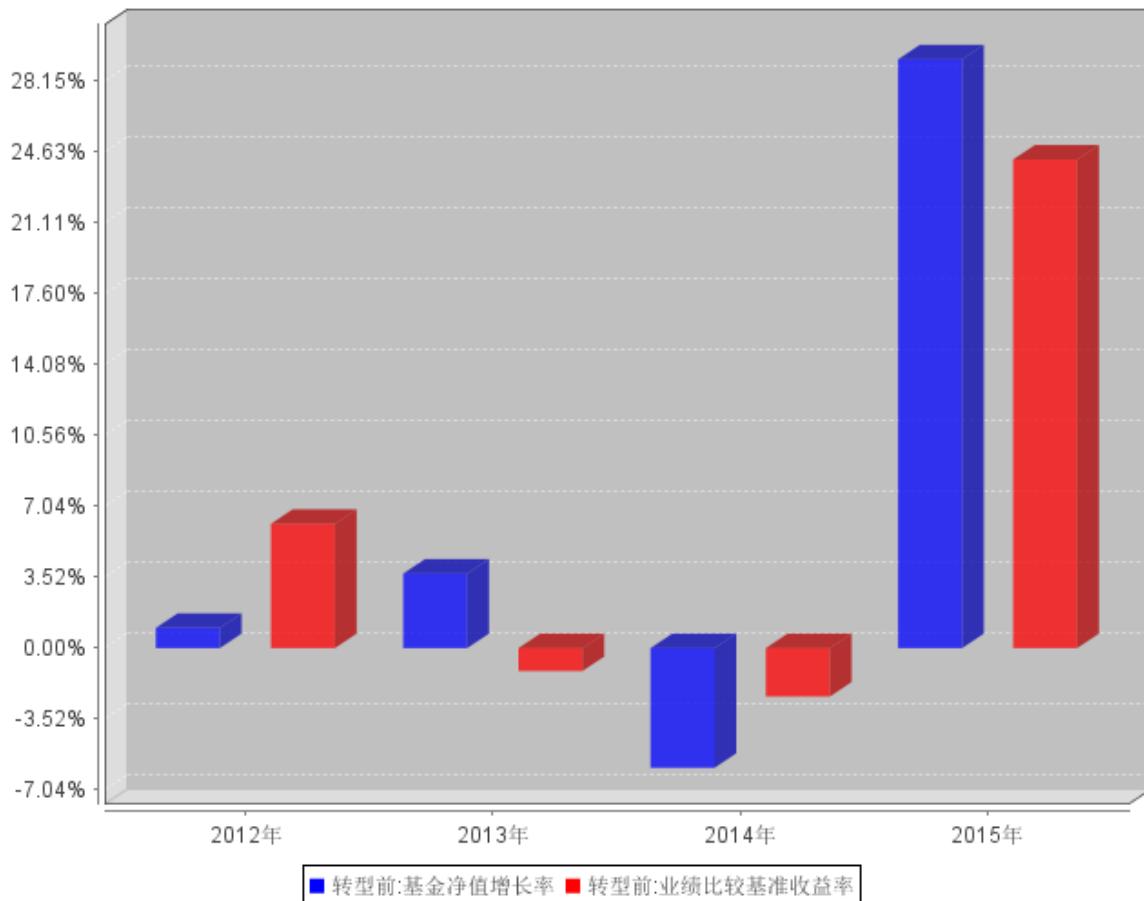
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 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

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对比图



注：本基金于 2005 年 1 月 12 日成立，本图所列基金合同生效当年的净值增长率，系按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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，另外十只基金一天治稳健双盈债券型证券投资基金、天治财富增长证券投资基金、天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）、天治天得

利货币市场基金、天治中国制造 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、天治新消费灵活配置混合型证券投资基金（转型自 2011 年 8 月 4 日生效的天治成长精选混合型证券投资基金）、天治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、2004 年 6 月 29 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、2016 年 7 月 6 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		
曾海	本基金基金经理	2015 年 6 月 12 日	-	8	2001 年 7 月至 2005 年 8 月就职于上海丝绸（集团）股份有限公司，2005 年 9 月至 2006 年 8 月就职于皮尔磁工业自动化贸易（上海）有限公司，2008 年 7 月至 2009 年 2 月就职于交银国际控股有限公司任研究员，2009 年 3 月至 2011 年 2 月就职于国联证券股份有限公司任研究员，2011 年 3 月至 2013 年 6 月就职于光大保德信基金管理有限公司任研究员，2013 年 9 月至今就职于天治基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理。

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）

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		
曾海	本基金基金经理	2015 年 6 月 12 日	-	8	2001 年 7 月至 2005 年 8 月就职于上海丝绸（集团）股份有限公司，2005 年 9 月至 2006 年 8 月就职于皮尔磁工业自动化贸易（上海）有限

					公司，2008 年 7 月至 2009 年 2 月就职于交银国际控股有限公司任研究员，2009 年 3 月至 2011 年 2 月就职于国联证券股份有限公司任研究员，2011 年 3 月至 2013 年 6 月就职于光大保德信基金管理有限公司任研究员，2013 年 9 月至今就职于天治基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

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。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》、《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》、《天治品质优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）的价差率是否超过阀值；
- 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，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 年证券市场基本呈“L”型走势，其中 1 月份由于经济增速下台阶，汇率大幅波动，风险偏好下降，限售禁令解除及不适应中国 A 股市场的“熔断”制度设计等，引起资本市场恐慌，一项流动性颇好的资产再次失去流动性，市场哀鸿遍野，不断寻底，到 2 月下旬才有所稳住。3-4 月，大规模涌出的投资需求给市场造成了强劲复苏的假象，市场表现非常靓丽；而 5-6 月，“权威人士”发表文章，为涌出的投资需求降温，给中国未来几年的经济定调“L”型的增长、持续加强的结构性改革，供给侧改革再不是坐而论道，开始由上而下的执行开来。市场也突然降温，短时间内迅速调整，这样的弱势在 6 月英国意外退欧后发挥到极致。7-12 月，市场触底反弹，回归基本面的影响，同时交易量有所萎缩，进入整固阶段。全年来看沪深 300 下跌 11.28%，中小板指下跌 22.89%，创业板指下跌 27.71%，大盘蓝筹股表现明显好于小盘成长股。

从行业表现来看，食品饮料、建筑等低估值行业实现正收益，采掘、钢铁、化工等受益于供给侧收缩的周期性行业跌幅较小，计算机、传媒等成长性行业跌幅较大。表明市场风险偏好下降，配置偏向低估值和景气向上的行业。

本基金投资策略主要是配置成长股，特别是在 2016 年 4 月份进行了产品转型后，强化了行业、主题策略，将投资策略聚焦于在受益于低碳经济的相关主题。由于一季度维持了较高的仓位，且配置了以计算机为代表的成长股，净值回撤较大。二季度本基金加强了与低碳相关主题的配置，特别是新能源汽车产业链、锂电池材料、智能汽车等板块的配置，净值取得一定的回升。但三季度由于新能源汽车关于补贴的政策低于预期，相关板块和个股跌幅较大，导致基金净值出现回撤。三季度末和四季度初，本基金配置了成长性较为确定的电子板块，及受益于一带一路和 PPP 推广的建筑板块，基金净值在四季度前期取得较好的表现。2016 年 12 月由于流动性紧张导致的市场风险偏好下降，市场普遍下跌，基金净值承受了较大的回撤。基于降低波动性的考虑，本基金适当降低了仓位，且配置了价值蓝筹股进行防御。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末，本报告期（2016 年 4 月 18 日-2016 年 12 月 31 日），本基金份额净值为 0.6757 元，报告期内本基金份额净值增长率为-14.87%，业绩比较基准收益率为 0.11%，低于业绩比较基准收益率 14.98%。

截至转型前报告期末，本报告期（2016 年 1 月 1 日-2016 年 4 月 17 日），本基金份额净值为

0.8063 元，截止报告末六个月内本基金份额净值增长率为 -11.46%，业绩比较基准收益率为 -1.33%，低于业绩比较基准收益率 10.13%。

#### 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，我们认为对于金融过度自由化的反思将在市场和监管层面得到延续，并将会基于此反思持续影响后续政策和监管思路，机构行为也将会发生变化，因此，注重资产安全将是 2017 年的一个重要目标。另外，从全球的尺度来看，全球已经开始反思货币投放过度的经济异化和社会异化的副作用，随着欧美日经济的好转，欧日的量化宽松退出的概率越来越大、美联储加息的步伐加快的概率也在上升。在这样的背景下，中国主动排雷的概率较大，中央经济工作会议的精神正是这一观点的佐证，因此，降杠杆、防风险将是政策主线，货币政策较 2016 年不友好是绝大概率事件，但国内经济政策方面，供给侧改革将会继续深化，一带一路、结构性改革创新等旨在解决中国发展中结构性问题和关乎国计民生的领域将会持续得到政府鼓励和资助，对经济下行起到稳定器的作用。

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，使得国内经济将会存在一定的不确定性。

由于流动性大概率偏紧影响市场风险偏好，并且无风险利率上行将导致市场估值中枢下移，因此 2017 年 A 股市场将面临较大的挑战。但由于部分利空因素已经被市场预期，预计不会出现 2016 年一季度暴跌行情。我们认为 2017 年的证券市场将重回基本面，估值安全边际更高的行业相对吸引力较大。同时符合国家政策方向的改革受益板块，有利于稳定经济的基建板块，以及受益于通胀的消费板块将具备相对优势。

基于 2017 年市场整体风险偏好下降的判断，本基金将基于资产安全的角度出发，立足于行业、公司基本面，在消费、环保、一带一路、智能汽车以及改革受益等领域进行重点配置，在市场分化过程中发挥“自下而上”精选个股的优势，稳中求进，力争在 2017 年为投资者带来较好的投资回报。

#### 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后台各部门日常工作，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

本基金 2016 年度未进行收益分配，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

转型后，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 4 月 18 日至 2016 年 12 月 31 日。管理人已于 2016 年 7 月 14 日向中国证监会报告了相关情况及解决方案。本基金报告期内基金份额持有人数在 200 人以上。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金（原天治品质优选混合型证券投资基金）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人——天治基金管理有限公司在天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金（原天治品质优选混合型证券投资基金）的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价

格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金（原天治品质优选混合型证券投资基金）未进行利润分配。

### 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

由天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金（原天治品质优选混合型证券投资基金）基金管理人——天治基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 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_B02 号

注：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。

### 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	天治低碳经济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低碳经济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 4 月 18 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。

	<p>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存在重大错报获取合理保证。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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，公允反映了天治低碳经济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 4 月 18 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_B11 号

注：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。

### 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	天治品质优选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品质优选混合型证券投资基金管理人财务报表，包括 2016 年 4 月 17 日的资产负债表和 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 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	<p>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存在重大错报获取合理保证。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	
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，公允反映了天治品质优选混合型证券投资基金管理人 2016 年 4 月 17 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 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：天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金管理人

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
<b>资产:</b>		
银行存款	7.4.7.1	11, 072, 124. 67
结算备付金		391, 237. 33
存出保证金		83, 386. 81
交易性金融资产	7.4.7.2	20, 053, 850. 00
其中: 股票投资		20, 053, 850. 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		—
应收利息	7.4.7.5	2, 932. 55
应收股利		—
应收申购款		4, 504. 22
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	181, 615. 85
资产总计		31, 789, 651. 43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	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		30, 740. 72
应付管理人报酬		39, 532. 92
应付托管费		6, 588. 82
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	864, 920. 53
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	56, 877. 54
负债合计		998, 660. 53
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	45, 570, 944. 31
未分配利润	7.4.7.10	-14, 779, 953. 41
所有者权益合计		30, 790, 990. 90

负债和所有者权益总计		31, 789, 651. 43
------------	--	------------------

注：（1）报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6757 元，基金份额总额 45,570,944.31 份。

（2）本基金由天治品质优选混合型证券投资基金转型而成，转型日为 2016 年 4 月 18 日。

## 7.2 利润表

会计主体：天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 4 月 18 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4月18日(基金合同生效日)至2016 年12月31日
<b>一、收入</b>		-3, 985, 591. 68
1. 利息收入		49, 696. 44
其中：存款利息收入	7.4.7.11	49, 691. 73
债券利息收入		4. 71
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3, 168, 694. 52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3, 346, 663. 57
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	4, 572. 29
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	173, 396. 76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-906, 637. 49
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	40, 043. 89
<b>减：二、费用</b>		1, 741, 891. 23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	351, 724. 35
2. 托管费	7.4.10.2.2	58, 620. 75
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1, 158, 932. 17
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	172, 613. 96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5, 727, 482. 91

减：所得税费用			-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)			-5,727,482.91

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年4月18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4月18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)	74,404,343.09	-14,412,180.60	59,992,162.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,727,482.91	-5,727,482.91
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)	-28,833,398.78	5,359,710.10	-23,473,688.68
其中：1. 基金申购款	13,207,805.30	-3,699,103.65	9,508,701.65
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-42,041,204.08	9,058,813.75	-32,982,390.33
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)	45,570,944.31	-14,779,953.41	30,790,990.90

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

天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系由天治品质优选混合型证券投资基金转型而来，天治品质优选混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]192号文《关于同意天治品质优选混合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

2005 年 1 月 12 日正式生效，首次设立募集规模为 1,212,569,189.32 份基金份额。根据《天治基金管理有限公司关于天治品质优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品质优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 4 月 18 日表决通过了《关于天治品质优选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。自该日起，天治品质优选混合型证券投资基金正式更名为天治低碳经济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《天治品质优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和注册登记机构为天治基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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，投资于受益于低碳经济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。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于受益于低碳经济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：中证内地低碳经济主题指数收益率×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管理业务的指导意见》、《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 4 月 18 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 4 月 18 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目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的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。

### **7.4.5 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 12 月 31 日
活期存款	11,072,124.67
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计:	11,072,124.67

#### 7.4.7.2 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	20,796,091.00	20,053,850.00	-742,241.00
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	20,796,091.00	20,053,850.00	-742,241.00

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 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12月31日
应收活期存款利息	2,718.88
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	176.10
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	0.07
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	37.50
合计	2,932.55

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
其他应收款	181,615.85
待摊费用	-
合计	181,615.85

#### 7.4.7.7 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	864,920.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	864,920.53

#### 7.4.7.8 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	90.62
其他	6,786.92
预提费用	50,000.00
合计	56,877.54

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016年4月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日	账面金额
基金合同生效日	74,404,343.09	74,404,343.09

本期申购	13,207,805.30	13,207,805.30
本期赎回(以“-”号填列)	-42,041,204.08	-42,041,204.08
- 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	45,570,944.31	45,570,944.31

#### 7.4.7.10 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	10,942,957.52	-25,355,138.12	-14,412,180.60
本期利润	-4,820,845.42	-906,637.49	-5,727,482.91
本期基金份额交易产生的变动数	-4,290,929.50	9,650,639.60	5,359,710.10
其中：基金申购款	889,224.22	-4,588,327.87	-3,699,103.65
基金赎回款	-5,180,153.72	14,238,967.47	9,058,813.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,831,182.60	-16,611,136.01	-14,779,953.41

#### 7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2016年4月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	41,816.91
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	6,391.72
其他	1,483.10
合计	49,691.73

#### 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4月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	393,499,689.97
减：卖出股票成本总额	396,846,353.54

买卖股票差价收入	-3,346,663.57
----------	---------------

#### 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4月18日至2016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	4,572.29
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	4,572.29

##### 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4月18日至2016年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	24,477.00
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	19,900.00
减：应收利息总额	4.71
买卖债券差价收入	4,572.29

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期末无债券投资收益——赎回差价收入

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期末无债券投资收益——申购差价收入

##### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末无资产支持证券。

#### 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：本基金本报告期末无贵金属投资。

#### **7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期末无贵金属投资。

#### **7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期末无贵金属投资。

#### **7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期末无贵金属投资。

#### **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：本基金本报告期末无衍生工具——买卖权证。

##### **7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期末无衍生工具——其他投资收益。

#### **7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月18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	173,396.76
基金投资产生的股利收益	-
合计	173,396.76

#### **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4月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-906,637.49
——股票投资	-906,637.49
——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	-906, 637. 49

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月18日(基金合同生效日)至2016年 12月31日
基金赎回费收入	39, 428. 67
转换费收入	615. 22
合计	40, 043. 89

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月18日(基金合同生效日)至2016年 12月31日
交易所市场交易费用	1, 158, 932. 17
银行间市场交易费用	-
合计	1, 158, 932. 17

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月18日(基金合同生效日)至2016 年12月31日
审计费用	35, 246. 12
信息披露费	98, 687. 84
账户维护费用	-1, 500. 00
其他	40, 050. 00
银行汇划费用	130. 00
合计	172, 613. 96

#### 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 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
中国民生银行股份有限公司	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

注：本基金本报告期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：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

##### 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 4 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	351,724.35
其中：支付销售机构的客	93,084.76

户维护费	
------	--

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 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 4 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	58,620.75

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 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：本基金本报告年度无销售服务费。

#### 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：本基金本报告期内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

份额单位：份

项目	本期
	2016 年 4 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

	-	-	-
基金合同生效日持有的基金份额	9,234,489.16		
期初持有的基金份额			
期间申购/买入总份额			
期间因拆分变动份额			
减：期间赎回/卖出总份额			
期末持有的基金份额	9,234,489.16		
期末持有的基金份额占基金总份额比例	20.26%		

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

#### 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4月18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
民生银行	11,072,124.67	41,816.91

#### 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：本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

### 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：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2016年12月31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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	说明
601375	中原证	2016年12	2017年	新股流通	-	4.00	1,000	4,000.00	4,000.00	-

	券	月 20 日	1 月 3 日	受限						
--	---	--------	---------	----	--	--	--	--	--	--

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300323	华灿光电	2016 年 4 月 18 日	重大事项停牌	8.77	2017 年 1 月 9 日	8.65	200,000	1,657,000.00	1,754,000.00	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大事项停牌	14.66	-	-	70,000	1,034,300.00	1,026,200.00	-

#### 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 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 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。

#### **15.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **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、存出保证金及债券投资等。

##### 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	11,072,124.67	-	-	-	-	-	11,072,124.67
结算备付金	391,237.33	-	-	-	-	-	391,237.33
存出保证金	83,386.81	-	-	-	-	-	83,386.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	20,053,850.00	20,053,850.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,932.55	2,932.55
应收申购款	-	-	-	-	-	4,504.22	4,504.22
其他资产	-	-	-	-	-	181,615.85	181,615.85
资产总计	11,546,748.81	-	-	-	-	20,242,902.62	31,789,651.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	30,740.72	30,740.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	39,532.92	39,532.92
应付托管费	-	-	-	-	-	6,588.82	6,588.82
应付交易费用	-	-	-	-	-	864,920.53	864,920.53
其他负债	-	-	-	-	-	56,877.54	56,877.54
负债总计	-	-	-	-	-	998,660.53	998,660.53
利率敏感度缺口	11,546,748.81	-	-	-	-	19,244,242.09	30,790,990.90

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。

##### 7.4.13.4.1.2 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 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	20,053,850.00	65.13
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	20,053,850.00	65.13

#### 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12月31日）
	业绩比较基准变动+5%	3,462,608.46
	业绩比较基准变动-5%	-3,462,608.46

#### 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

#### 7.4.14.1.1 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 17,269,650.00 元，属于第二层次的余额为人民币 2,784,200.00 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次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：天治品质优选

报告截止日： 2016 年 4 月 17 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 4 月 17 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	8,437,847.43	5,988,117.96
结算备付金		943,827.65	882,026.76
存出保证金		165,645.11	175,808.96
交易性金融资产	7.4.7.2	51,640,199.98	36,670,271.00
其中：股票投资		51,640,199.98	36,670,271.00
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		359,129.78	2,087,910.63
应收利息	7.4.7.5	11,566.40	1,825.50
应收股利		-	-
应收申购款		6,609.75	20,439.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		61,564,826.10	45,826,400.15
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年4月17日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		370,015.73	101,459.29
应付赎回款		75,536.83	33,872.61
应付管理人报酬		41,725.16	58,994.41
应付托管费		6,954.22	9,832.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	962,354.22	575,080.07
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	116,077.45	201,414.58
负债合计		1,572,663.61	980,653.35
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	74,404,343.09	43,956,438.22
未分配利润	7.4.7.10	-14,412,180.60	889,308.58
所有者权益合计		59,992,162.49	44,845,746.80
负债和所有者权益总计		61,564,826.10	45,826,400.15

注：1、报告截止日 2016 年 4 月 17 日，基金份额净值 0.8063 元，基金份额总额 74,404,343.09 份。

2、本基金自 2016 年 4 月 18 日起转型为天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金。

## 7.2 利润表

会计主体：天治品质优选

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-8,177,766.04	21,925,893.05
1. 利息收入		51,370.57	86,620.41
其中：存款利息收入	7.4.7.11	30,347.10	86,507.40
债券利息收入		-	113.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		21,023.47	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-6,379,448.03	28,486,914.13
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-6,380,245.88	28,325,220.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-54,323.91
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	797.85	216,017.47
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.17	-1,857,525.46	-6,697,810.22
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	7,836.88	50,168.73
<b>减：二、费用</b>		899,554.73	3,979,056.04
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	176,867.10	922,316.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	29,477.90	153,719.26
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	624,103.69	2,694,850.68
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	69,106.04	208,170.00
<b>三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)</b>		-9,077,320.77	17,946,837.01
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号 填列)</b>		-9,077,320.77	17,946,837.01

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治品质优选

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 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）	43,956,438.22	889,308.58	44,845,746.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,077,320.77	-9,077,320.77
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)	30,447,904.87	-6,224,168.41	24,223,736.46
其中：1. 基金申购款	38,444,911.69	-7,762,011.44	30,682,900.25
2. 基金赎回款	-7,997,006.82	1,537,843.03	-6,459,163.79
四、本期间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）	74,404,343.09	-14,412,180.60	59,992,162.49
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）	85,832,918.52	-4,379,600.82	81,453,317.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,946,837.01	17,946,837.01
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)	-41,876,480.30	-12,677,927.61	-54,554,407.91
其中：1. 基金申购款	41,056,796.93	7,273,524.23	48,330,321.16
2. 基金赎回款	-82,933,277.23	-19,951,451.84	-102,884,729.07
四、本期间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）	43,956,438.22	889,308.58	44,845,746.80

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

基金管理人负责人

闫译文

主管会计工作负责人

黄宇星

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

天治品质优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”)证监基金字[2004]192号文《关于同意天治品质优选混合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2005年1月12日正式生效,首次设立募集规模为1,212,569,189.32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和注册登记机构为天治基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《天治基金管理有限公司关于天治品质优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品质优选混合型证券投资基金基金名称变更的公告》,本基金基金份额持有人大会于2016年4月18日表决通过了《关于天治品质优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低碳经济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《天治品质优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,包括国内依法公开发行上市的各类股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金以股票品种为主要投资标的,以自下而上的股票优选策略为主,辅以自上而下的类别资产配置、行业资产配置,并依托专业的管理经验和有效的风险预算管理,构建和动态调整投资组合,以追求基金资产的中长期稳定增值。

本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

### 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管理业务的指导意见》、《关于证券投资基金管理<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

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品质优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品质优选混合型证券投资基金名称变更的公告》，本基金于 2016 年 4 月 18 日起转型为天治低碳经济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 4 月 17 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 17 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 4 月 17 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的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) 每一基金份额享有同等分配权；

- (2) 基金收益分配比例按有关规定制定，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%；
- (3) 基金投资当期亏损，则不进行收益分配；
- (4) 基金当年收益应先弥补以前年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- (5) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- (6) 基金收益分配方式：投资人可以选择现金分红或红利再投资的方式。投资人选择红利再投资时，分配的基金收益以红利发放日的基金份额净值为基准自动转换为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (7) 基金收益每年最多分配 6 次，但若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；
- (8) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **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、国家税务总局财税字[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、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金管理政策的通知》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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

#### 7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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、国家税务总局财税字[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；

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	上年度末
	2016年4月17日	2015年12月31日
活期存款	8,437,847.43	5,988,117.96
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	8,437,847.43	5,988,117.96

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	成本	公允价值	估值增值
股票	51,475,803.49	51,640,199.98	164,396.49
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	51,475,803.49	51,640,199.98	164,396.49
项目	上年度末		
	2015年12月31日		
成本	公允价值	估值增值	
股票	34,648,349.05	36,670,271.00	2,021,921.95
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	34,648,349.05	36,670,271.00	2,021,921.95

### 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 4 月 17 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	9,882.63	1,349.50
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	905.34	396.90
应收债券利息	—	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	580.01	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	198.42	79.10
合计	11,566.40	1,825.50

### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 4 月 17 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	962,354.22	575,080.07
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	962,354.22	575,080.07

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年4月17日	2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	224.49	127.66
其他	6,786.92	6,786.92
预提费用	109,066.04	194,500.00
合计	116,077.45	201,414.58

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	43,956,438.22	43,956,438.22
本期申购	38,444,911.69	38,444,911.69
本期赎回(以“-”号填列)	-7,997,006.82	-7,997,006.82
- 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	74,404,343.09	74,404,343.09

注：申购含红利再投、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	13,501,059.47	-12,611,750.89	889,308.58
本期利润	-7,219,795.31	-1,857,525.46	-9,077,320.77
本期基金份额交易产生的变动数	4,661,693.36	-10,885,861.77	-6,224,168.41
其中：基金申购款	5,886,497.71	-13,648,509.15	-7,762,011.44
基金赎回款	-1,224,804.35	2,762,647.38	1,537,843.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,942,957.52	-25,355,138.12	-14,412,180.60

#### 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4月 17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	24,680.06	71,051.54
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,262.05	11,493.86
其他	1,404.99	3,962.00
合计	30,347.10	86,507.40

#### 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4月 17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	199,394,324.58	910,939,121.07
减：卖出股票成本总额	205,774,570.46	882,613,900.50
买卖股票差价收入	-6,380,245.88	28,325,220.57

#### 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4月 17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	-	-54,323.91
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	-	-54,323.91

##### 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4月	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月
----	-------------------------	-------------------------------

	月17日	31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	3,447,001.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	3,500,260.45
减：应收利息总额	-	1,064.76
买卖债券差价收入	-	-54,323.91

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比区间均无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比区间均无债券投资收益——申购差价收入。

#### 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 2016年1月1日至2016年4 月17日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
股票投资产生的股利收益	797.85	216,017.47
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	797.85	216,017.47

#### 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4 月17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	-1,857,525.46	-6,697,810.22
——股票投资	-1,857,525.46	-6,697,810.22
——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	-1,857,525.46	-6,697,810.22

#### 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4月 17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	7,515.39	43,429.04
转换费收入	321.49	6,739.69
合计	7,836.88	50,168.73

#### 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4月 17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	624,103.69	2,694,850.68
银行间市场交易费用	-	-
合计	624,103.69	2,694,850.68

#### 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4月17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	14,753.88	50,000.00
信息披露费	41,312.16	140,000.00
账户维护费用	3,000.00	18,000.00
其他	10,000.00	-
银行汇划费用	40.00	170.00
合计	69,106.04	208,170.00

#### 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，本基金无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
中国民生银行股份有限公司	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
中国吉林森工集团有限责任公司	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：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 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无应支付的关联方佣金。

#### 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4 月17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	176,867.10	922,316.10
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	40,788.09	223,812.38

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

##### 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4 月17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	29,477.90	153,719.26
----------------	-----------	------------

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期及上年度可比区间均无销售服务费。

#### 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

项目	本期 2016年1月1日至2016年4 月17日	份额单位：份	
		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日	
基金合同生效日持有的基 金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	9,234,489.16	9,234,489.16	
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	9,234,489.16	9,234,489.16	
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	12.41%	21.01%	

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

##### 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

关联方 名称	本期 2016年1月1日至2016年4月17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
中国民生银行 股份有限公司	8,437,847.43	24,680.06	5,988,117.96	71,051.54

#### 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：本基金本报告期内及上年度可比区间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 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：本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2016 年 4 月 17 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：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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
600576	万家文化	2016 年 4 月 11 日	重大事项停牌	23.22	2016 年 9 月 13 日	20.12	130,000	2,872,864.56	3,018,600.00	-
000002	万科 A	2015 年 12 月 21 日	重大事项停牌	19.62	2016 年 7 月 4 日	21.99	100,000	2,105,400.00	1,962,000.00	-
300038	梅泰诺	2015 年 12 月 16 日	重大事项停牌	48.63	2016 年 9 月 1 日	51.02	25,000	1,334,360.00	1,215,750.00	-
600745	中茵股份	2016 年 1 月 27 日	重大事项停牌	27.71	2016 年 5 月 4 日	26.70	40,000	1,047,618.00	1,108,400.00	-

##### 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 4 月 17 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 4 月 17 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：本基金本报告期及上年度可比区间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：本基金本报告期及上年度可比区间无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **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4月17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
<b>资产</b>							
银行存款	8,437,847.43	-	-	-	-	-	8,437,847.43
结算备付金	943,827.65	-	-	-	-	-	943,827.65
存出保证金	165,645.11	-	-	-	-	-	165,645.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	51,640,199.98	51,640,199.98
应收证券清算款	-	-	-	-	-	359,129.78	359,129.78
应收利息	-	-	-	-	-	11,566.40	11,566.40
应收申购款	-	-	-	-	-	6,609.75	6,609.75
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,547,320.19	-	-	-	-	52,017,505.91	61,564,826.10
<b>负债</b>							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	370,015.73	370,015.73
应付赎回款	-	-	-	-	-	75,536.83	75,536.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41,725.16	41,725.16
应付托管费	-	-	-	-	-	6,954.22	6,954.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	962,354.22	962,354.22
其他负债	-	-	-	-	-	116,077.45	116,077.45
负债总计	-	-	-	-	-	1,572,663.61	1,572,663.61
利率敏感度缺口	9,547,320.19	-	-	-	-	50,444,842.30	59,992,162.49
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	5,988,117.96	-	-	-	-	-	5,988,117.96
结算备付金	882,026.76	-	-	-	-	-	882,026.76
存出保证金	175,808.96	-	-	-	-	-	175,808.96
交易性金融资产	-	-	-	-	-36,670,271.00	36,670,271.00	
应收证券清算款	-	-	-	-	-2,087,910.63	2,087,910.63	
应收利息	-	-	-	-	-	1,825.50	1,825.50
应收申购款	-	-	-	-	-	20,439.34	20,439.34
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,045,953.68	-	-	-	-38,780,446.47	45,826,400.15	
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	101,459.29	101,459.29
应付赎回款	-	-	-	-	-	33,872.61	33,872.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	58,994.41	58,994.41
应付托管费	-	-	-	-	-	9,832.39	9,832.39
应付交易费用	-	-	-	-	-	575,080.07	575,080.07
其他负债	-	-	-	-	-	201,414.58	201,414.58
负债总计	-	-	-	-	-	980,653.35	980,653.35
利率敏感度缺口	7,045,953.68	-	-	-	-37,799,793.12	44,845,746.80	

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期末及上年度末未持有债券资产，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 2016年4月17日	上年度末 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	51,640,199.98	86.08	36,670,271.00	81.77
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	51,640,199.98	86.08	36,670,271.00	81.77

#### 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4月17日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准变动 5%	3,958,850.62	3,045,324.83
	业绩比较基准变动-5%	-3,958,850.62	-3,045,324.83

#### 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 4 月 17 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 44,335,449.98 元，属于第二层次的余额为人民币 7,304,750.00 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2015 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 28,732,710.00 元，属于第二层次的余额为人民币 7,937,561.00 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次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	20,053,850.00	63.08
	其中：股票	20,053,850.00	63.08
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	11,463,362.00	36.06
7	其他各项资产	272,439.43	0.86
8	合计	31,789,651.43	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	-	-
C	制造业	13,842,500.00	44.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,775,350.00	15.51
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	4,000.00	0.01
K	房地产业	567,000.00	1.84
L	租赁和商务服务业	865,000.00	2.81
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	20,053,850.00	65.13

### 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	300323	华灿光电	200,000	1,754,000.00	5.70
2	000651	格力电器	50,000	1,231,000.00	4.00
3	600820	隧道股份	100,000	1,101,000.00	3.58
4	600887	伊利股份	60,000	1,056,000.00	3.43
5	000625	长安汽车	70,000	1,045,800.00	3.40
6	300088	长信科技	70,000	1,026,200.00	3.33
7	600068	葛洲坝	103,000	946,570.00	3.07
8	601800	中国交建	62,000	941,780.00	3.06
9	600104	上汽集团	40,000	938,000.00	3.05
10	002501	利源精制	75,000	920,250.00	2.99
11	600031	三一重工	150,000	915,000.00	2.97
12	601717	郑煤机	130,000	913,900.00	2.97
13	600273	嘉化能源	95,000	912,950.00	2.96
14	600039	四川路桥	190,000	900,600.00	2.92
15	000726	鲁泰 A	70,000	896,700.00	2.91
16	601618	中国中冶	190,000	885,400.00	2.88
17	600415	小商品城	100,000	865,000.00	2.81
18	600409	三友化工	90,000	845,100.00	2.74
19	600843	上工申贝	40,000	752,800.00	2.44
20	002690	美亚光电	30,000	634,800.00	2.06
21	000006	深振业 A	60,000	567,000.00	1.84
22	601375	中原证券	1,000	4,000.00	0.01

## 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	601688	华泰证券	5,505,750.00	17.88
2	000858	五粮液	5,310,450.00	17.25
3	601186	中国铁建	5,064,918.46	16.45
4	300207	欣旺达	4,112,950.00	13.36
5	002475	立讯精密	4,011,000.00	13.03
6	000776	广发证券	3,921,426.00	12.74
7	002074	国轩高科	3,775,305.45	12.26

8	300324	旋极信息	3,754,407.60	12.19
9	600884	杉杉股份	3,649,319.10	11.85
10	002155	湖南黄金	3,649,000.00	11.85
11	300017	网宿科技	3,463,925.00	11.25
12	002670	国盛金控	3,098,272.00	10.06
13	002340	格林美	3,083,463.00	10.01
14	600887	伊利股份	3,077,659.00	10.00
15	002292	奥飞娱乐	3,065,442.00	9.96
16	300136	信维通信	3,063,553.00	9.95
17	002245	澳洋顺昌	2,999,750.00	9.74
18	002460	赣锋锂业	2,959,871.00	9.61
19	002108	沧州明珠	2,943,430.00	9.56
20	600273	嘉化能源	2,771,850.00	9.00
21	002358	森源电气	2,662,000.00	8.65
22	600104	上汽集团	2,661,800.00	8.64
23	000630	铜陵有色	2,614,700.00	8.49
24	002008	大族激光	2,610,500.00	8.48
25	300073	当升科技	2,605,374.00	8.46
26	000783	长江证券	2,601,093.00	8.45
27	600109	国金证券	2,592,730.00	8.42
28	601800	中国交建	2,572,140.00	8.35
29	600366	宁波韵升	2,458,626.00	7.98
30	300367	东方网力	2,352,750.00	7.64
31	300059	东方财富	2,344,872.00	7.62
32	600199	金种子酒	2,342,968.00	7.61
33	600030	中信证券	2,226,000.00	7.23
34	300224	正海磁材	2,160,542.00	7.02
35	600699	均胜电子	2,052,000.00	6.66
36	002701	奥瑞金	2,024,692.00	6.58
37	300010	立思辰	2,000,000.00	6.50
38	000333	美的集团	1,991,315.00	6.47
39	600702	沱牌舍得	1,983,114.00	6.44
40	000050	深天马 A	1,978,511.00	6.43
41	600198	大唐电信	1,974,720.00	6.41
42	600197	伊力特	1,966,500.00	6.39
43	600183	生益科技	1,960,000.00	6.37

44	002273	水晶光电	1, 955, 821. 71	6. 35
45	601069	西部黄金	1, 936, 376. 00	6. 29
46	300383	光环新网	1, 933, 791. 20	6. 28
47	600170	上海建工	1, 933, 000. 00	6. 28
48	300133	华策影视	1, 915, 188. 00	6. 22
49	002062	宏润建设	1, 913, 913. 00	6. 22
50	002508	老板电器	1, 898, 100. 00	6. 16
51	002271	东方雨虹	1, 896, 750. 00	6. 16
52	600521	华海药业	1, 888, 000. 00	6. 13
53	600711	盛屯矿业	1, 886, 500. 00	6. 13
54	600667	太极实业	1, 881, 000. 00	6. 11
55	002501	利源精制	1, 872, 998. 00	6. 08
56	000758	中色股份	1, 855, 249. 00	6. 03
57	300458	全志科技	1, 829, 521. 00	5. 94
58	002165	红宝丽	1, 797, 500. 00	5. 84
59	002413	雷科防务	1, 751, 780. 00	5. 69
60	600707	彩虹股份	1, 741, 600. 00	5. 66
61	300336	新文化	1, 663, 038. 00	5. 40
62	601788	光大证券	1, 658, 700. 00	5. 39
63	600999	招商证券	1, 651, 875. 00	5. 36
64	603686	龙马环卫	1, 651, 000. 00	5. 36
65	601377	兴业证券	1, 598, 484. 40	5. 19
66	002304	洋河股份	1, 569, 288. 91	5. 10
67	002329	皇氏集团	1, 558, 500. 00	5. 06
68	600585	海螺水泥	1, 542, 686. 70	5. 01
69	600383	金地集团	1, 540, 179. 00	5. 00
70	600535	天士力	1, 521, 565. 00	4. 94
71	300144	宋城演艺	1, 470, 000. 00	4. 77
72	002335	科华恒盛	1, 455, 997. 00	4. 73
73	600690	青岛海尔	1, 428, 613. 00	4. 64
74	002511	中顺洁柔	1, 406, 110. 00	4. 57
75	300327	中颖电子	1, 346, 000. 00	4. 37
76	000651	格力电器	1, 327, 500. 00	4. 31
77	600837	海通证券	1, 279, 164. 00	4. 15
78	002236	大华股份	1, 262, 500. 00	4. 10
79	002466	天齐锂业	1, 252, 486. 00	4. 07

80	601678	滨化股份	1, 243, 600. 00	4. 04
81	002664	信质电机	1, 204, 699. 00	3. 91
82	600418	江淮汽车	1, 194, 000. 00	3. 88
83	600547	山东黄金	1, 190, 000. 00	3. 86
84	300100	双林股份	1, 174, 650. 00	3. 81
85	000625	长安汽车	1, 161, 000. 00	3. 77
86	601169	北京银行	1, 146, 050. 00	3. 72
87	600562	国睿科技	1, 110, 000. 00	3. 60
88	002256	兆新股份	1, 098, 960. 00	3. 57
89	002323	雅百特	1, 088, 750. 00	3. 54
90	300271	华宇软件	1, 077, 435. 44	3. 50
91	601009	南京银行	1, 075, 500. 00	3. 49
92	002418	康盛股份	1, 065, 490. 00	3. 46
93	600820	隧道股份	1, 064, 000. 00	3. 46
94	002519	银河电子	1, 057, 500. 00	3. 43
95	600708	光明地产	1, 054, 000. 00	3. 42
96	600754	锦江股份	1, 052, 100. 00	3. 42
97	002241	歌尔股份	1, 036, 000. 00	3. 36
98	300088	长信科技	1, 034, 300. 00	3. 36
99	000712	锦龙股份	1, 033, 663. 00	3. 36
100	600637	东方明珠	1, 032, 500. 00	3. 35
101	000750	国海证券	1, 031, 251. 00	3. 35
102	600323	瀚蓝环境	1, 029, 000. 00	3. 34
103	601766	中国中车	1, 028, 000. 00	3. 34
104	600168	武汉控股	1, 026, 000. 00	3. 33
105	300037	新宙邦	1, 023, 813. 60	3. 33
106	600068	葛洲坝	1, 023, 540. 00	3. 32
107	600826	兰生股份	1, 020, 529. 00	3. 31
108	002636	金安国纪	1, 020, 432. 00	3. 31
109	600779	水井坊	1, 020, 250. 00	3. 31
110	300078	思创医惠	1, 020, 100. 00	3. 31
111	000826	启迪桑德	1, 016, 550. 00	3. 30
112	002454	松芝股份	1, 014, 590. 00	3. 30
113	002456	欧菲光	1, 012, 500. 00	3. 29
114	000799	酒鬼酒	1, 008, 000. 00	3. 27
115	300284	苏交科	1, 006, 500. 00	3. 27

116	603008	喜临门	1,005,900.00	3.27
117	000060	中金岭南	1,004,504.00	3.26
118	002357	富临运业	1,004,000.00	3.26
119	600061	国投安信	1,002,000.00	3.25
120	601777	力帆股份	1,001,500.00	3.25
121	300068	南都电源	999,680.00	3.25
122	300373	扬杰科技	995,078.00	3.23
123	300014	亿纬锂能	994,200.00	3.23
124	300025	华星创业	994,050.00	3.23
125	600498	烽火通信	994,000.00	3.23
126	000425	徐工机械	994,000.00	3.23
127	002736	国信证券	994,000.00	3.23
128	002502	骅威文化	993,500.00	3.23
129	002488	金固股份	991,800.00	3.22
130	002458	益生股份	991,350.00	3.22
131	603328	依顿电子	990,500.00	3.22
132	000876	新希望	990,000.00	3.22
133	600845	宝信软件	990,000.00	3.22
134	300160	秀强股份	989,769.00	3.21
135	002554	惠博普	988,400.00	3.21
136	300127	银河磁体	987,250.00	3.21
137	002039	黔源电力	987,115.00	3.21
138	600639	浦东金桥	986,780.00	3.20
139	601199	江南水务	985,500.00	3.20
140	002673	西部证券	985,300.00	3.20
141	000423	东阿阿胶	985,150.00	3.20
142	000998	隆平高科	985,000.00	3.20
143	300077	国民技术	984,672.00	3.20
144	300346	南大光电	983,520.00	3.19
145	000558	莱茵体育	983,500.00	3.19
146	002455	百川股份	981,200.00	3.19
147	601555	东吴证券	980,000.00	3.18
148	600386	北巴传媒	979,967.00	3.18
149	002262	恩华药业	979,930.00	3.18
150	000426	兴业矿业	979,200.00	3.18
151	603868	飞科电器	978,650.00	3.18

152	601799	星宇股份	978,280.00	3.18
153	600756	浪潮软件	978,000.00	3.18
154	002247	帝龙文化	978,000.00	3.18
155	000498	山东路桥	977,000.00	3.17
156	601689	拓普集团	976,426.00	3.17
157	002229	鸿博股份	975,600.00	3.17
158	600031	三一重工	975,000.00	3.17
159	002244	滨江集团	974,700.00	3.17
160	600676	交运股份	974,650.00	3.17
161	600136	当代明诚	974,000.00	3.16
162	601669	中国电建	973,700.00	3.16
163	300026	红日药业	972,881.00	3.16
164	002546	新联电子	972,000.00	3.16
165	601000	唐山港	971,500.00	3.16
166	600729	重庆百货	969,707.00	3.15
167	000728	国元证券	969,634.00	3.15
168	600039	四川路桥	969,300.00	3.15
169	300148	天舟文化	969,065.00	3.15
170	000970	中科三环	968,500.00	3.15
171	300007	汉威电子	967,988.00	3.14
172	601198	东兴证券	967,500.00	3.14
173	000401	冀东水泥	967,200.00	3.14
174	300364	中文在线	967,100.00	3.14
175	600697	欧亚集团	966,699.88	3.14
176	300113	顺网科技	966,240.00	3.14
177	603609	禾丰牧业	965,450.00	3.14
178	002311	海大集团	964,801.40	3.13
179	600446	金证股份	964,450.00	3.13
180	002051	中工国际	963,900.00	3.13
181	300232	洲明科技	963,566.00	3.13
182	002341	新纶科技	960,000.00	3.12
183	601877	正泰电器	960,000.00	3.12
184	601618	中国中冶	959,500.00	3.12
185	603589	口子窖	957,000.00	3.11
186	002448	中原内配	956,757.60	3.11
187	600730	中国高科	952,540.00	3.09

188	600643	爱建集团	951,798.00	3.09
189	600436	片仔癀	951,707.00	3.09
190	002355	兴民智通	950,000.00	3.09
191	300071	华谊嘉信	949,993.00	3.09
192	600835	上海机电	949,853.00	3.08
193	002249	大洋电机	949,070.94	3.08
194	600497	驰宏锌锗	948,000.00	3.08
195	300467	迅游科技	947,344.61	3.08
196	002034	美欣达	947,000.00	3.08
197	300043	星辉娱乐	942,500.00	3.06
198	002110	三钢闽光	940,600.00	3.05
199	601717	郑煤机	940,563.00	3.05
200	601099	太平洋	936,000.00	3.04
201	601699	潞安环能	935,934.00	3.04
202	600111	北方稀土	935,700.00	3.04
203	600048	保利地产	934,500.00	3.03
204	002242	九阳股份	933,750.00	3.03
205	002615	哈尔斯	932,000.00	3.03
206	601668	中国建筑	931,000.00	3.02
207	002078	太阳纸业	930,893.00	3.02
208	600597	光明乳业	929,559.90	3.02
209	000823	超声电子	929,500.00	3.02
210	002407	多氟多	928,484.50	3.02
211	002385	大北农	928,000.00	3.01
212	002176	江特电机	924,000.00	3.00
213	000937	冀中能源	923,922.00	3.00
214	600987	航民股份	923,788.00	3.00
215	000538	云南白药	920,421.50	2.99
216	603993	洛阳钼业	920,000.00	2.99
217	300031	宝通科技	917,000.00	2.98
218	600157	永泰能源	916,000.00	2.97
219	600782	新钢股份	915,243.00	2.97
220	300332	天壕环境	914,124.00	2.97
221	000860	顺鑫农业	913,611.00	2.97
222	600287	江苏舜天	906,500.00	2.94
223	300027	华谊兄弟	904,050.00	2.94

224	601208	东材科技	900,000.00	2.92
225	002597	金禾实业	897,000.00	2.91
226	000726	鲁泰 A	896,000.00	2.91
227	000988	华工科技	892,500.00	2.90
228	000661	长春高新	891,967.65	2.90
229	002533	金杯电工	888,000.00	2.88
230	002618	丹邦科技	887,000.00	2.88
231	000418	小天鹅 A	886,500.00	2.88
232	601390	中国中铁	885,000.00	2.87
233	600006	东风汽车	879,977.00	2.86
234	600110	诺德股份	876,000.00	2.84
235	002169	智光电气	872,000.00	2.83
236	600409	三友化工	864,000.00	2.81
237	600415	小商品城	850,000.00	2.76
238	300097	智云股份	828,000.00	2.69
239	300033	同花顺	819,950.00	2.66
240	002707	众信旅游	814,000.00	2.64
241	600392	盛和资源	810,000.00	2.63
242	000888	峨眉山 A	809,500.00	2.63
243	000969	安泰科技	807,000.00	2.62
244	601222	林洋能源	805,950.00	2.62
245	600141	兴发集团	802,485.00	2.61
246	002200	云投生态	797,900.00	2.59
247	002089	新海宜	796,000.00	2.59
248	600823	世茂股份	790,000.00	2.57
249	300365	恒华科技	780,000.00	2.53
250	300389	艾比森	778,500.00	2.53
251	300446	乐凯新材	773,850.00	2.51
252	600303	曙光股份	759,885.00	2.47
253	600843	上工申贝	740,000.00	2.40
254	300351	永贵电器	716,243.00	2.33
255	000100	TCL 集团	716,000.00	2.33
256	600489	中金黄金	700,200.00	2.27
257	300048	合康新能	680,700.00	2.21
258	600886	国投电力	656,000.00	2.13
259	002690	美亚光电	650,100.00	2.11

260	300095	华伍股份	647,500.00	2.10
261	002537	海立美达	633,976.50	2.06
262	300253	卫宁健康	632,640.00	2.05

### 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	601688	华泰证券	7,679,975.56	24.94%
2	300073	当升科技	5,192,210.05	16.86%
3	601186	中国铁建	5,171,350.00	16.80%
4	000858	五粮液	5,147,396.00	16.72%
5	300207	欣旺达	4,435,885.00	14.41%
6	300059	东方财富	4,389,000.00	14.25%
7	002475	立讯精密	4,338,585.00	14.09%
8	000776	广发证券	4,192,545.00	13.62%
9	300324	旋极信息	3,892,818.96	12.64%
10	002155	湖南黄金	3,773,800.00	12.26%
11	300133	华策影视	3,557,350.00	11.55%
12	002074	国轩高科	3,543,160.00	11.51%
13	300136	信维通信	3,416,159.00	11.09%
14	300010	立思辰	3,414,322.00	11.09%
15	002670	国盛金控	3,368,943.00	10.94%
16	600884	杉杉股份	3,328,190.50	10.81%
17	300017	网宿科技	3,211,510.00	10.43%
18	002730	电光科技	3,152,725.20	10.24%
19	002340	格林美	3,130,597.00	10.17%
20	600837	海通证券	3,076,800.00	9.99%
21	002292	奥飞娱乐	3,035,950.00	9.86%
22	002108	沧州明珠	2,983,528.00	9.69%
23	002245	澳洋顺昌	2,971,380.00	9.65%
24	002460	赣锋锂业	2,857,365.00	9.28%
25	601799	星宇股份	2,738,014.00	8.89%
26	002358	森源电气	2,731,406.12	8.87%
27	000783	长江证券	2,690,520.00	8.74%
28	300271	华宇软件	2,665,950.00	8.66%
29	300232	洲明科技	2,608,190.20	8.47%
30	000630	铜陵有色	2,553,400.00	8.29%
31	002008	大族激光	2,506,100.00	8.14%
32	600109	国金证券	2,482,810.00	8.06%
33	600366	宁波韵升	2,465,073.00	8.01%

34	002311	海大集团	2,413,769.45	7.84%
35	600576	万家文化	2,356,901.00	7.65%
36	300224	正海磁材	2,254,705.00	7.32%
37	600030	中信证券	2,195,400.00	7.13%
38	600199	金种子酒	2,144,846.00	6.97%
39	600699	均胜电子	2,138,772.00	6.95%
40	600183	生益科技	2,101,440.50	6.82%
41	000050	深天马A	2,047,760.00	6.65%
42	300367	东方网力	2,035,350.00	6.61%
43	600198	大唐电信	2,001,130.20	6.50%
44	600197	伊力特	1,992,762.00	6.47%
45	600170	上海建工	1,991,200.00	6.47%
46	002062	宏润建设	1,955,552.20	6.35%
47	002590	万安科技	1,952,943.00	6.34%
48	002273	水晶光电	1,947,147.50	6.32%
49	002701	奥瑞金	1,945,000.00	6.32%
50	601069	西部黄金	1,938,110.00	6.29%
51	600521	华海药业	1,922,308.00	6.24%
52	600730	中国高科	1,910,651.00	6.21%
53	000002	万科A	1,910,500.00	6.20%
54	300168	万达信息	1,898,562.00	6.17%
55	000333	美的集团	1,886,250.00	6.13%
56	600667	太极实业	1,856,175.86	6.03%
57	300383	光环新网	1,851,050.00	6.01%
58	002271	东方雨虹	1,849,305.00	6.01%
59	600383	金地集团	1,830,600.00	5.95%
60	000758	中色股份	1,811,051.00	5.88%
61	002508	老板电器	1,800,981.00	5.85%
62	600887	伊利股份	1,795,330.00	5.83%
63	002165	红宝丽	1,792,240.00	5.82%
64	300196	长海股份	1,770,000.00	5.75%
65	600707	彩虹股份	1,750,402.00	5.68%
66	600273	嘉化能源	1,746,500.00	5.67%
67	002624	完美世界	1,738,828.00	5.65%
68	600702	沱牌舍得	1,736,688.00	5.64%
69	600999	招商证券	1,724,400.00	5.60%
70	600633	浙报传媒	1,718,000.00	5.58%
71	002413	雷科防务	1,710,340.90	5.55%
72	601377	兴业证券	1,707,956.00	5.55%
73	300458	全志科技	1,678,000.00	5.45%
74	000971	高升控股	1,677,752.00	5.45%
75	600711	盛屯矿业	1,674,489.00	5.44%
76	600104	上汽集团	1,673,437.00	5.43%
77	601788	光大证券	1,664,488.00	5.41%

78	600158	中体产业	1, 662, 000. 00	5. 40%
79	603686	龙马环卫	1, 654, 788. 00	5. 37%
80	601800	中国交建	1, 652, 294. 00	5. 37%
81	002548	金新农	1, 618, 713. 00	5. 26%
82	300287	飞利信	1, 599, 626. 98	5. 20%
83	300336	新文化	1, 581, 110. 00	5. 13%
84	002329	皇氏集团	1, 559, 000. 00	5. 06%
85	601028	玉龙股份	1, 536, 023. 00	4. 99%
86	600535	天士力	1, 510, 750. 00	4. 91%
87	600585	海螺水泥	1, 501, 000. 00	4. 87%
88	300144	宋城演艺	1, 485, 200. 00	4. 82%
89	002304	洋河股份	1, 455, 881. 20	4. 73%
90	002511	中顺洁柔	1, 452, 539. 00	4. 72%
91	002335	科华恒盛	1, 428, 012. 00	4. 64%
92	002256	兆新股份	1, 404, 000. 00	4. 56%
93	002664	信质电机	1, 338, 245. 00	4. 35%
94	600690	青岛海尔	1, 338, 200. 00	4. 35%
95	300327	中颖电子	1, 298, 700. 00	4. 22%
96	002236	大华股份	1, 274, 000. 00	4. 14%
97	600547	山东黄金	1, 241, 750. 00	4. 03%
98	300038	梅泰诺	1, 232, 504. 00	4. 00%
99	300127	银河磁体	1, 210, 200. 00	3. 93%
100	601012	隆基股份	1, 210, 000. 00	3. 93%
101	601678	滨化股份	1, 193, 099. 00	3. 87%
102	002466	天齐锂业	1, 191, 000. 00	3. 87%
103	601689	拓普集团	1, 162, 500. 00	3. 78%
104	600418	江淮汽车	1, 157, 649. 00	3. 76%
105	601169	北京银行	1, 157, 000. 00	3. 76%
106	000060	中金岭南	1, 148, 735. 00	3. 73%
107	600386	北巴传媒	1, 146, 612. 50	3. 72%
108	300346	南大光电	1, 142, 302. 00	3. 71%
109	002418	康盛股份	1, 135, 317. 00	3. 69%
110	600562	国睿科技	1, 124, 337. 01	3. 65%
111	601766	中国中车	1, 118, 250. 00	3. 63%
112	000728	国元证券	1, 102, 850. 00	3. 58%
113	300068	南都电源	1, 085, 600. 00	3. 53%
114	002051	中工国际	1, 075, 500. 00	3. 49%
115	601555	东吴证券	1, 073, 100. 00	3. 49%
116	601668	中国建筑	1, 060, 200. 00	3. 44%
117	002519	银河电子	1, 058, 750. 00	3. 44%
118	000712	锦龙股份	1, 053, 740. 00	3. 42%
119	600168	武汉控股	1, 049, 640. 00	3. 41%
120	600323	瀚蓝环境	1, 045, 300. 00	3. 39%
121	600729	重庆百货	1, 039, 650. 00	3. 38%

122	600697	欧亚集团	1,038,000.00	3.37%
123	600637	东方明珠	1,036,400.00	3.37%
124	002407	多氟多	1,036,140.00	3.37%
125	603008	喜临门	1,031,641.70	3.35%
126	600498	烽火通信	1,025,518.00	3.33%
127	002244	滨江集团	1,025,000.00	3.33%
128	600745	中茵股份	1,024,047.00	3.33%
129	002456	欧菲光	1,023,000.00	3.32%
130	600754	锦江股份	1,021,508.00	3.32%
131	601009	南京银行	1,020,300.00	3.31%
132	603328	依顿电子	1,018,500.00	3.31%
133	600061	国投安信	1,018,200.00	3.31%
134	603609	禾丰牧业	1,016,766.00	3.30%
135	002241	歌尔股份	1,015,615.00	3.30%
136	000970	中科三环	1,014,500.00	3.29%
137	002385	大北农	1,013,100.00	3.29%
138	000558	莱茵体育	1,011,070.50	3.28%
139	300025	华星创业	1,010,233.00	3.28%
140	002554	惠博普	1,008,000.00	3.27%
141	300026	红日药业	1,007,501.00	3.27%
142	300014	亿纬锂能	1,007,263.00	3.27%
143	600136	当代明诚	1,007,000.00	3.27%
144	000401	冀东水泥	1,006,400.00	3.27%
145	300100	双林股份	1,003,200.00	3.26%
146	002039	黔源电力	1,002,612.00	3.26%
147	601199	江南水务	1,002,245.00	3.25%
148	000425	徐工机械	996,800.00	3.24%
149	603589	口子窖	996,050.00	3.23%
150	002673	西部证券	995,980.00	3.23%
151	601777	力帆股份	994,509.00	3.23%
152	002110	三钢闽光	993,760.01	3.23%
153	600676	交运股份	992,858.00	3.22%
154	600826	兰生股份	990,215.00	3.22%
155	002615	哈尔斯	990,000.00	3.22%
156	002229	鸿博股份	988,732.00	3.21%
157	300077	国民技术	987,500.00	3.21%
158	300148	天舟文化	987,030.00	3.21%
159	601198	东兴证券	987,000.00	3.21%
160	300364	中文在线	986,100.00	3.20%
161	000423	东阿阿胶	986,000.00	3.20%
162	000998	隆平高科	986,000.00	3.20%
163	600436	片仔癀	982,050.00	3.19%
164	600708	光明地产	980,508.00	3.18%
165	002341	新纶科技	976,000.00	3.17%

166	601000	唐山港	974, 250. 00	3. 16%
167	002454	松芝股份	974, 143. 00	3. 16%
168	601099	太平洋	973, 050. 00	3. 16%
169	002618	丹邦科技	972, 373. 12	3. 16%
170	002249	大洋电机	972, 003. 00	3. 16%
171	002546	新联电子	972, 000. 00	3. 16%
172	300027	华谊兄弟	971, 750. 00	3. 16%
173	300007	汉威电子	963, 033. 00	3. 13%
174	002455	百川股份	961, 670. 04	3. 12%
175	000823	超声电子	960, 800. 00	3. 12%
176	300160	秀强股份	960, 800. 00	3. 12%
177	601669	中国电建	959, 400. 00	3. 12%
178	002262	恩华药业	958, 120. 00	3. 11%
179	603868	飞科电器	952, 862. 00	3. 09%
180	600835	上海机电	950, 300. 00	3. 09%
181	002242	九阳股份	949, 500. 00	3. 08%
182	002323	雅百特	947, 250. 00	3. 08%
183	002034	美欣达	945, 000. 00	3. 07%
184	000826	启迪桑德	943, 950. 00	3. 07%
185	300284	苏交科	943, 410. 00	3. 06%
186	000876	新希望	943, 250. 00	3. 06%
187	600782	新钢股份	941, 000. 00	3. 06%
188	002078	太阳纸业	940, 800. 00	3. 06%
189	600779	水井坊	940, 500. 00	3. 05%
190	002458	益生股份	939, 634. 00	3. 05%
191	000988	华工科技	935, 278. 00	3. 04%
192	300373	扬杰科技	934, 541. 00	3. 04%
193	002176	江特电机	933, 000. 00	3. 03%
194	002355	兴民智通	930, 000. 00	3. 02%
195	000538	云南白药	928, 500. 00	3. 02%
196	300043	星辉娱乐	923, 000. 00	3. 00%
197	000426	兴业矿业	918, 000. 00	2. 98%
198	300332	天壕环境	915, 500. 00	2. 97%
199	600643	爱建集团	914, 400. 00	2. 97%
200	600845	宝信软件	912, 000. 00	2. 96%
201	600497	驰宏锌锗	912, 000. 00	2. 96%
202	002636	金安国纪	911, 640. 00	2. 96%
203	600987	航民股份	910, 000. 00	2. 96%
204	002169	智光电气	908, 000. 00	2. 95%
205	601390	中国中铁	907, 000. 00	2. 95%
206	002501	利源精制	906, 292. 00	2. 94%
207	000418	小天鹅 A	906, 000. 00	2. 94%
208	000799	酒鬼酒	905, 600. 00	2. 94%
209	000750	国海证券	905, 318. 50	2. 94%

210	300071	华谊嘉信	905,250.00	2.94%
211	002448	中原内配	903,065.00	2.93%
212	002597	金禾实业	903,000.00	2.93%
213	600639	浦东金桥	902,661.59	2.93%
214	601699	潞安环能	895,200.00	2.91%
215	002247	帝龙文化	892,875.00	2.90%
216	000661	长春高新	892,397.10	2.90%
217	601877	正泰电器	892,066.00	2.90%
218	002357	富临运业	890,423.00	2.89%
219	002736	国信证券	888,260.00	2.88%
220	300037	新宙邦	886,621.74	2.88%
221	600111	北方稀土	885,214.00	2.87%
222	600756	浪潮软件	880,500.00	2.86%
223	600157	永泰能源	880,000.00	2.86%
224	300467	迅游科技	879,200.00	2.86%
225	600446	金证股份	876,680.00	2.85%
226	600597	光明乳业	875,102.00	2.84%
227	300078	思创医惠	874,500.00	2.84%
228	603993	洛阳钼业	872,000.00	2.83%
229	000860	顺鑫农业	870,000.00	2.83%
230	600048	保利地产	866,000.00	2.81%
231	002488	金固股份	858,400.00	2.79%
232	601208	东材科技	850,337.00	2.76%
233	002502	骅威文化	849,800.00	2.76%
234	300113	顺网科技	847,200.00	2.75%
235	600287	江苏舜天	841,400.00	2.73%
236	300031	宝通科技	836,500.00	2.72%
237	000498	山东路桥	834,072.00	2.71%
238	000937	冀中能源	832,000.00	2.70%
239	002533	金杯电工	820,200.00	2.66%
240	600110	诺德股份	816,000.00	2.65%
241	002707	众信旅游	814,976.00	2.65%
242	000969	安泰科技	810,000.00	2.63%
243	600006	东风汽车	791,218.00	2.57%
244	000888	峨眉山 A	786,600.00	2.55%
245	600303	曙光股份	778,820.00	2.53%
246	601222	林洋能源	774,345.33	2.51%
247	600823	世茂股份	771,044.70	2.50%
248	300365	恒华科技	770,140.00	2.50%
249	300097	智云股份	766,500.00	2.49%
250	300033	同花顺	765,500.00	2.49%
251	600141	兴发集团	762,500.00	2.48%
252	002200	云投生态	761,815.00	2.47%
253	300389	艾比森	750,000.00	2.44%

254	300446	乐凯新材	737,250.00	2.39%
255	002089	新海宜	721,000.00	2.34%
256	000100	TCL 集团	704,000.00	2.29%
257	600392	盛和资源	700,000.00	2.27%
258	300351	永贵电器	699,500.00	2.27%
259	300048	合康新能	690,600.00	2.24%
260	600489	中金黄金	675,000.00	2.19%
261	600886	国投电力	661,000.00	2.15%
262	300253	卫宁健康	630,000.00	2.05%
263	300095	华伍股份	622,500.00	2.02%

### 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	366,073,286.05
卖出股票收入（成交）总额	393,499,689.97

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

本基金本报告期末未持有按债券品种分类的债券投资组合。

### 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

本基金本报告期末未持有按债券品种分类的债券投资组合。

### 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

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

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

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

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

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	83,386.81
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,932.55
5	应收申购款	4,504.22
6	其他应收款	181,615.85
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	272,439.43

#### 8.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	300323	华灿光电	1,754,000.00	5.70	重大事项停牌
2	300088	长信科技	1,026,200.00	3.33	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	51,640,199.98	83.88
	其中：股票	51,640,199.98	83.88
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	9,381,675.08	15.24
7	其他资产	542,951.04	0.88
8	合计	61,564,826.10	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	-	-

C	制造业	23,792,050.00	39.66
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	3,018,600.00	5.03
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	12,567,136.84	20.95
J	金融业	3,973,423.14	6.62
K	房地产业	4,710,240.00	7.85
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	3,578,750.00	5.97
S	综合	-	-
	合计	51,640,199.98	86.07

### 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	002730	电光科技	80,000	3,564,000.00	5.94
2	600576	万家文化	130,000	3,018,600.00	5.03
3	300073	当升科技	70,000	2,422,700.00	4.04
4	300059	东方财富	50,000	2,264,500.00	3.77
5	601688	华泰证券	119,946	2,169,823.14	3.62
6	300168	万达信息	70,000	1,969,800.00	3.28
7	000002	万科 A	100,000	1,962,000.00	3.27

8	002590	万安科技	70,000	1,894,200.00	3.16
9	300196	长海股份	50,000	1,850,000.00	3.08
10	600837	海通证券	120,000	1,803,600.00	3.01
11	300323	华灿光电	200,000	1,798,000.00	3.00
12	300133	华策影视	65,000	1,790,750.00	2.98
13	600633	浙报传媒	100,000	1,788,000.00	2.98
14	002624	完美世界	45,000	1,767,600.00	2.95
15	000971	高升控股	60,000	1,734,000.00	2.89
16	300271	华宇软件	85,000	1,728,900.00	2.88
17	300232	洲明科技	50,000	1,714,500.00	2.86
18	300287	飞利信	119,978	1,653,296.84	2.76
19	601799	星宇股份	45,000	1,643,400.00	2.74
20	601028	玉龙股份	200,000	1,638,000.00	2.73
21	600158	中体产业	80,000	1,620,800.00	2.70
22	002311	海大集团	100,000	1,616,000.00	2.69
23	300010	立思辰	61,400	1,449,040.00	2.42
24	002548	金新农	80,000	1,396,800.00	2.33
25	601012	隆基股份	100,000	1,330,000.00	2.22
26	300038	梅泰诺	25,000	1,215,750.00	2.03
27	600730	中国高科	68,000	1,127,440.00	1.88
28	600745	中茵股份	40,000	1,108,400.00	1.85
29	600271	航天信息	10,000	600,300.00	1.00

## 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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300271	华宇软件	4,874,258.53	10.87
2	600576	万家文化	4,401,450.00	9.81
3	300168	万达信息	4,209,616.00	9.39
4	300059	东方财富	3,843,551.00	8.57
5	300010	立思辰	3,578,800.00	7.98
6	600048	保利地产	3,531,300.00	7.87
7	002730	电光科技	3,495,650.64	7.79
8	002329	皇氏集团	3,272,371.80	7.30
9	600489	中金黄金	3,069,100.00	6.84

10	000978	桂林旅游	2,845,684.10	6.35
11	002308	威创股份	2,834,500.00	6.32
12	300291	华录百纳	2,809,627.80	6.27
13	002590	万安科技	2,765,000.00	6.17
14	601028	玉龙股份	2,720,081.00	6.07
15	600958	东方证券	2,640,597.93	5.89
16	601799	星宇股份	2,631,787.00	5.87
17	600754	锦江股份	2,609,500.00	5.82
18	300073	当升科技	2,593,300.00	5.78
19	000060	中金岭南	2,479,000.00	5.53
20	300144	宋城演艺	2,455,432.00	5.48
21	002280	联络互动	2,343,704.00	5.23
22	002074	国轩高科	2,281,355.00	5.09
23	600497	驰宏锌锗	2,204,354.00	4.92
24	601688	华泰证券	2,116,203.58	4.72
25	300166	东方国信	2,088,172.00	4.66
26	300037	新宙邦	2,079,383.60	4.64
27	300332	天壕环境	2,079,335.00	4.64
28	600352	浙江龙盛	2,063,200.00	4.60
29	002001	新和成	2,032,775.00	4.53
30	000709	河钢股份	1,999,574.00	4.46
31	300031	宝通科技	1,990,443.00	4.44
32	002460	赣锋锂业	1,965,584.00	4.38
33	300047	天源迪科	1,957,500.00	4.36
34	300367	东方网力	1,885,750.00	4.20
35	300136	信维通信	1,849,379.55	4.12
36	600837	海通证券	1,817,467.00	4.05
37	300274	阳光电源	1,800,500.00	4.01
38	300133	华策影视	1,786,308.00	3.98
39	300232	洲明科技	1,782,623.00	3.98
40	300196	长海股份	1,770,000.00	3.95
41	300198	纳川股份	1,763,500.00	3.93
42	002777	久远银海	1,759,500.00	3.92
43	600633	浙报传媒	1,729,394.00	3.86
44	002624	完美世界	1,721,008.00	3.84
45	002311	海大集团	1,711,606.00	3.82

46	000971	高升控股	1, 671, 000. 00	3. 73
47	300287	飞利信	1, 666, 374. 30	3. 72
48	300323	华灿光电	1, 657, 000. 00	3. 69
49	601336	新华保险	1, 640, 000. 00	3. 66
50	600804	鹏博士	1, 577, 000. 00	3. 52
51	600158	中体产业	1, 569, 620. 00	3. 50
52	600030	中信证券	1, 559, 600. 00	3. 48
53	600399	抚顺特钢	1, 558, 500. 00	3. 48
54	600136	当代明诚	1, 555, 047. 00	3. 47
55	300001	特锐德	1, 511, 460. 00	3. 37
56	600019	宝钢股份	1, 483, 200. 00	3. 31
57	002241	歌尔股份	1, 474, 000. 00	3. 29
58	600531	豫光金铅	1, 460, 847. 17	3. 26
59	002548	金新农	1, 411, 100. 00	3. 15
60	600366	宁波韵升	1, 401, 285. 00	3. 12
61	002292	奥飞娱乐	1, 392, 000. 00	3. 10
62	300352	北信源	1, 379, 928. 20	3. 08
63	600699	均胜电子	1, 332, 000. 00	2. 97
64	300190	维尔利	1, 320, 758. 15	2. 95
65	601777	力帆股份	1, 246, 497. 04	2. 78
66	600562	国睿科技	1, 239, 700. 00	2. 76
67	600547	山东黄金	1, 209, 500. 00	2. 70
68	600177	雅戈尔	1, 195, 600. 00	2. 67
69	600662	强生控股	1, 186, 500. 00	2. 65
70	600519	贵州茅台	1, 175, 000. 00	2. 62
71	300224	正海磁材	1, 159, 105. 30	2. 58
72	002501	利源精制	1, 146, 500. 00	2. 56
73	600114	东睦股份	1, 134, 000. 00	2. 53
74	600884	杉杉股份	1, 132, 000. 00	2. 52
75	600340	华夏幸福	1, 118, 919. 00	2. 50
76	000671	阳光城	1, 114, 262. 00	2. 48
77	000878	云南铜业	1, 113, 300. 00	2. 48
78	002605	姚记扑克	1, 105, 559. 00	2. 47
79	002019	亿帆医药	1, 104, 900. 00	2. 46
80	300148	天舟文化	1, 104, 500. 00	2. 46
81	600589	广东榕泰	1, 101, 789. 00	2. 46

82	300033	同花顺	1,099,600.00	2.45
83	002123	梦网荣信	1,093,526.87	2.44
84	000530	大冷股份	1,080,440.00	2.41
85	002413	雷科防务	1,078,444.00	2.40
86	002395	双象股份	1,077,253.00	2.40
87	002224	三力士	1,072,570.84	2.39
88	002429	兆驰股份	1,070,650.00	2.39
89	300100	双林股份	1,069,252.00	2.38
90	600730	中国高科	1,068,075.88	2.38
91	002467	二六三	1,067,080.00	2.38
92	300498	温氏股份	1,065,890.68	2.38
93	300339	润和软件	1,064,300.00	2.37
94	002446	盛路通信	1,064,135.00	2.37
95	002007	华兰生物	1,062,350.00	2.37
96	603008	喜临门	1,061,968.52	2.37
97	002262	恩华药业	1,060,159.99	2.36
98	600501	航天晨光	1,048,833.00	2.34
99	600745	中茵股份	1,047,618.00	2.34
100	002146	荣盛发展	1,047,500.00	2.34
101	002244	滨江集团	1,047,000.00	2.33
102	601198	东兴证券	1,042,000.00	2.32
103	002303	美盈森	1,041,543.00	2.32
104	000959	首钢股份	1,039,000.00	2.32
105	300253	卫宁健康	1,037,022.00	2.31
106	000558	莱茵体育	1,035,821.00	2.31
107	300262	巴安水务	1,029,000.00	2.29
108	300178	腾邦国际	1,025,543.83	2.29
109	300383	光环新网	1,024,940.00	2.29
110	600172	黄河旋风	1,022,265.00	2.28
111	002431	棕榈股份	1,014,200.00	2.26
112	000807	云铝股份	1,008,440.00	2.25
113	002092	中泰化学	999,323.00	2.23
114	300014	亿纬锂能	994,200.00	2.22
115	002699	美盛文化	993,000.00	2.21
116	002488	金固股份	991,800.00	2.21
117	002245	澳洋顺昌	990,000.00	2.21

118	300182	捷成股份	990,000.00	2.21
119	300251	光线传媒	990,000.00	2.21
120	000895	双汇发展	989,750.00	2.21
121	002271	东方雨虹	989,200.00	2.21
122	600303	曙光股份	989,100.00	2.21
123	002155	湖南黄金	986,188.00	2.20
124	600622	嘉宝集团	984,750.00	2.20
125	600386	北巴传媒	979,967.00	2.19
126	002247	帝龙文化	978,000.00	2.18
127	000716	黑芝麻	976,819.00	2.18
128	300199	翰宇药业	972,500.00	2.17
129	002443	金洲管道	971,900.20	2.17
130	300008	天海防务	971,315.00	2.17
131	600988	赤峰黄金	969,600.00	2.16
132	002285	世联行	963,000.00	2.15
133	600688	上海石化	951,446.00	2.12
134	002355	兴民智通	950,000.00	2.12
135	601699	潞安环能	935,934.00	2.09
136	600111	北方稀土	935,700.00	2.09
137	601555	东吴证券	934,400.00	2.08
138	002615	哈尔斯	932,000.00	2.08
139	002325	洪涛股份	929,789.00	2.07
140	002407	多氟多	928,484.50	2.07
141	300324	旋极信息	926,492.00	2.07
142	002167	东方锆业	920,000.00	2.05
143	600157	永泰能源	916,000.00	2.04
144	300302	同有科技	916,000.00	2.04

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300168	万达信息	3,858,485.00	8.60
2	600048	保利地产	3,551,756.05	7.92
3	600489	中金黄金	3,171,626.97	7.07

4	002329	皇氏集团	3,073,565.95	6.85
5	300271	华宇软件	2,993,110.70	6.67
6	300291	华录百纳	2,985,172.00	6.66
7	000978	桂林旅游	2,833,563.00	6.32
8	002308	威创股份	2,722,015.15	6.07
9	002280	联络互动	2,623,500.00	5.85
10	300010	立思辰	2,580,600.00	5.75
11	600754	锦江股份	2,479,300.00	5.53
12	300144	宋城演艺	2,433,089.00	5.43
13	600958	东方证券	2,427,079.01	5.41
14	300031	宝通科技	2,328,761.00	5.19
15	600497	驰宏锌锗	2,218,209.00	4.95
16	300047	天源迪科	2,203,585.00	4.91
17	000060	中金岭南	2,137,592.25	4.77
18	000558	莱茵体育	2,134,422.28	4.76
19	300332	天壕环境	2,107,064.00	4.70
20	300166	东方国信	2,069,600.00	4.61
21	002123	梦网荣信	2,060,513.00	4.59
22	002001	新和成	2,051,700.00	4.58
23	002466	天齐锂业	2,021,518.00	4.51
24	600352	浙江龙盛	1,998,796.70	4.46
25	300136	信维通信	1,995,825.00	4.45
26	002395	双象股份	1,963,864.00	4.38
27	002460	赣锋锂业	1,949,806.00	4.35
28	300450	先导智能	1,848,707.00	4.12
29	300198	纳川股份	1,830,000.00	4.08
30	000709	河钢股份	1,820,590.15	4.06
31	300059	东方财富	1,756,178.00	3.92
32	300274	阳光电源	1,725,916.50	3.85
33	600804	鹏博士	1,648,118.06	3.68
34	002777	久远银海	1,633,838.00	3.64
35	600136	当代明诚	1,579,741.50	3.52
36	002241	歌尔股份	1,572,101.00	3.51
37	600030	中信证券	1,565,000.00	3.49
38	601336	新华保险	1,560,000.00	3.48
39	600576	万家文化	1,486,466.68	3.31
40	600019	宝钢股份	1,475,000.00	3.29
41	600699	均胜电子	1,459,000.00	3.25

42	300001	特锐德	1, 443, 000. 00	3. 22
43	600531	豫光金铅	1, 425, 000. 00	3. 18
44	300352	北信源	1, 419, 302. 00	3. 16
45	002292	奥飞娱乐	1, 365, 039. 90	3. 04
46	600547	山东黄金	1, 328, 356. 00	2. 96
47	002407	多氟多	1, 319, 234. 00	2. 94
48	002074	国轩高科	1, 288, 000. 00	2. 87
49	600399	抚顺特钢	1, 274, 000. 00	2. 84
50	002717	岭南园林	1, 273, 800. 00	2. 84
51	002019	亿帆医药	1, 263, 810. 00	2. 82
52	600366	宁波韵升	1, 263, 500. 00	2. 82
53	600562	国睿科技	1, 240, 608. 00	2. 77
54	000793	华闻传媒	1, 240, 529. 00	2. 77
55	300190	维尔利	1, 234, 311. 22	2. 75
56	603008	喜临门	1, 225, 727. 44	2. 73
57	603588	高能环境	1, 224, 000. 00	2. 73
58	300324	旋极信息	1, 217, 349. 00	2. 71
59	300207	欣旺达	1, 206, 350. 00	2. 69
60	600177	雅戈尔	1, 200, 000. 00	2. 68
61	300037	新宙邦	1, 184, 000. 00	2. 64
62	601777	力帆股份	1, 170, 000. 00	2. 61
63	600519	贵州茅台	1, 152, 526. 00	2. 57
64	600884	杉杉股份	1, 140, 200. 00	2. 54
65	002183	怡亚通	1, 124, 300. 00	2. 51
66	300262	巴安水务	1, 104, 000. 00	2. 46
67	600988	赤峰黄金	1, 098, 900. 00	2. 45
68	002590	万安科技	1, 095, 286. 00	2. 44
69	603308	应流股份	1, 092, 739. 00	2. 44
70	300078	思创医惠	1, 089, 204. 00	2. 43
71	300251	光线传媒	1, 089, 150. 00	2. 43
72	002429	兆驰股份	1, 087, 500. 00	2. 42
73	002431	棕榈股份	1, 085, 425. 00	2. 42
74	002224	三力士	1, 077, 204. 00	2. 40
75	002325	洪涛股份	1, 077, 000. 00	2. 40
76	600593	大连圣亚	1, 070, 250. 00	2. 39
77	601198	东兴证券	1, 068, 500. 00	2. 38
78	002501	利源精制	1, 058, 502. 90	2. 36
79	300253	卫宁健康	1, 050, 000. 00	2. 34

80	600501	航天晨光	1, 043, 500. 00	2. 33
81	600688	上海石化	1, 041, 100. 00	2. 32
82	000878	云南铜业	1, 036, 800. 00	2. 31
83	600340	华夏幸福	1, 034, 420. 00	2. 31
84	000807	云铝股份	1, 031, 900. 00	2. 30
85	300148	天舟文化	1, 028, 857. 00	2. 29
86	300367	东方网力	1, 028, 850. 00	2. 29
87	600662	强生控股	1, 027, 801. 00	2. 29
88	300498	温氏股份	1, 020, 400. 00	2. 28
89	300339	润和软件	1, 014, 711. 30	2. 26
90	300302	同有科技	1, 010, 000. 00	2. 25
91	002285	世联行	1, 008, 803. 00	2. 25
92	002271	东方雨虹	1, 008, 461. 00	2. 25
93	601028	玉龙股份	1, 008, 428. 00	2. 25
94	300100	双林股份	1, 006, 500. 00	2. 24
95	600622	嘉宝集团	1, 001, 070. 00	2. 23
96	300008	天海防务	1, 000, 890. 00	2. 23
97	000895	双汇发展	1, 000, 000. 00	2. 23
98	000671	阳光城	1, 000, 000. 00	2. 23
99	300182	捷成股份	991, 144. 00	2. 21
100	002303	美盈森	990, 500. 00	2. 21
101	002169	智光电气	989, 606. 00	2. 21
102	002007	华兰生物	989, 049. 00	2. 21
103	000530	大冷股份	986, 795. 00	2. 20
104	000716	黑芝麻	982, 327. 00	2. 19
105	300033	同花顺	979, 573. 00	2. 18
106	600303	曙光股份	974, 433. 00	2. 17
107	300014	亿纬锂能	974, 080. 00	2. 17
108	002146	荣盛发展	965, 716. 00	2. 15
109	002092	中泰化学	962, 565. 00	2. 15
110	600172	黄河旋风	962, 000. 00	2. 15
111	002413	雷科防务	955, 617. 00	2. 13
112	300199	翰宇药业	948, 200. 00	2. 11
113	300224	正海磁材	945, 143. 00	2. 11
114	002244	滨江集团	942, 000. 00	2. 10
115	002467	二六三	927, 500. 00	2. 07
116	002605	姚记扑克	927, 400. 00	2. 07
117	002446	盛路通信	927, 210. 00	2. 07

118	601799	星宇股份	921,000.00	2.05
119	000971	高升控股	914,662.00	2.04
120	002155	湖南黄金	913,051.00	2.04
121	000959	首钢股份	911,644.00	2.03
122	002443	金洲管道	911,400.00	2.03
123	600114	东睦股份	904,335.00	2.02
124	002699	美盛文化	897,200.00	2.00

#### 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	222,602,024.90
卖出股票收入（成交）总额	199,394,324.58

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有按债券品种分类的债券投资组合。

#### 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

本基金本报告期末未持有按债券品种分类的债券投资组合。

#### 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

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

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

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

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

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

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。

### 8.12.2

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	165,645.11
2	应收证券清算款	359,129.78
3	应收股利	—
4	应收利息	11,566.40
5	应收申购款	6,609.75
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	542,951.04

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	占基金资产净值比	流通受限情况说明
----	------	------	-----------	----------	----------

			价值	例 (%)	
1	600576	万家文化	3,018,600.00	5.03	重大事项停牌
2	000002	万科 A	1,962,000.00	3.27	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
3,212	14,187.72	9,236,420.19	20.27%	36,334,524.12	79.73%

### 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	57,201.93	0.13%

### 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
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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2, 661	27, 961. 05	39, 386, 439. 03	52. 94%	35, 017, 904. 06	47. 06%

## 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	13, 665. 84	0. 02%

## 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	74, 404, 343. 09
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	13, 207, 805. 30
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	42, 041, 204. 08
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	45, 570, 944. 31

## § 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	1, 212, 569, 189. 32
本报告期期初基金份额总额	43, 956, 438. 22
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	38, 444, 911. 69
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	7, 997, 006. 82
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	74, 404, 343. 09

## § 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 3 月 31 日至 2016 年 4 月 15 间以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议了《关于天治品质优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 4 月 18 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 4 月 20 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品质优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 4 月 18 日表决通过了《关于天治品质优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》。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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，本基金投资策略为采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据宏观经济运行态势、政策变化、市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。

转型前，本基金投资策略为以股票品种为主要投资标的，以自下而上的股票优选策略为主，辅以自上而下的类别资产配置、行业资产配置，通过综合运用财务品质、经营品质和市场品质三大评估体系，优选具有长期发展潜力的上市公司股票进行投资，并在投资运作的各个环节实施全

面风险预算管理。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

本报告年度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 2005 年 1 月 12 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	
安信证券	1	312,445,381.50	41.13%	284,731.20	40.79%	-
民生证券	1	154,641,961.63	20.35%	140,925.65	20.19%	-
长江证券	1	90,927,310.44	11.97%	84,680.54	12.13%	-
东北证券	1	82,336,414.26	10.84%	76,679.73	10.98%	-
申银万国	1	68,338,443.29	8.99%	63,643.35	9.12%	-
银河证券	1	50,883,464.90	6.70%	47,387.66	6.79%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华创证券（退）	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

注：1、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、报告期内本基金退租华创证券 1 个交易单元。

### 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
安信证券	24,477.00	100.00%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华创证券（退）	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

### 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	
民生证券	1	185,628,231.07	43.99%	169,162.88	43.68%	-
安信证券	1	100,915,065.21	23.91%	91,963.89	23.75%	-
长江证券	1	83,776,245.47	19.85%	78,020.97	20.15%	-

东北证券	1	29,563,332.73	7.01%	27,532.17	7.11%	-
申银万国	1	18,823,198.00	4.46%	17,530.04	4.53%	-
银河证券	1	3,290,277.00	0.78%	3,064.20	0.79%	-
华创证券(退)	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

注：1、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、报告期内本基金退租华创证券 1 个交易单元。

### 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
民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	93,000,000.00	45.81%	-	-
东北证券	-	-	90,000,000.00	44.33%	-	-
申银万国	-	-	20,000,000.00	9.85%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券(退)	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

金元证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

## 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	天治低碳经济灵活配置混合型 证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、上海证 券报及公司官网	2016 年 4 月 20 日
2	天治低碳经济灵活配置混合型 证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证 券报及公司官网	2016 年 4 月 20 日
3	天治低碳经济灵活配置混合型 证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证 券报及公司官网	2016 年 4 月 20 日
4	天治基金管理有限公司关于天 治品质优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 券报及公司官网	2016 年 4 月 20 日
5	天治基金管理有限公司关于天 治品质优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 券报及公司官网	2016 年 4 月 20 日
6	天治品质优选混合型证券投资 基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证 券报及公司官网	2016 年 4 月 21 日
7	天治品质优选混合型证券投资 基金风险分析季度报告（2016 年第 1 季度）	中国证券报、上海证 券报及公司官网	2016 年 4 月 21 日
8	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 券报及公司官网	2016 年 4 月 22 日
9	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 券报及公司官网	2016 年 5 月 5 日

10	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、上海证券报及公司官网	2016 年 5 月 5 日
11	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、上海证券报及公司官网	2016 年 5 月 6 日
12	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、上海证券报及公司官网	2016 年 5 月 12 日
13	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份估值方法的公告	中国证券报、上海证券报及公司官网	2016 年 6 月 3 日
14	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、上海证券报及公司官网	2016 年 6 月 4 日
15	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、上海证券报及公司官网	2016 年 6 月 8 日
16	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、上海证券报及公司官网	2016 年 6 月 21 日
17	《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、上海证券报及公司官网	2016 年 6 月 24 日
18	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值方法的公告	中国证券报、上海证券报及公司官网	2016 年 6 月 29 日
19	天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度	中国证券报、上海证券报及公司官网	2016 年 7 月 19 日

	报告		
20	天治基金管理有限公司更正公告	中国证券报、上海证券报及公司官网	2016 年 8 月 6 日
21	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、上海证券报及公司官网	2016 年 8 月 17 日
22	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、上海证券报及公司官网	2016 年 8 月 24 日
23	天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报及公司官网	2016 年 8 月 29 日
24	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、上海证券报及公司官网	2016 年 9 月 20 日
25	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、上海证券报及公司官网	2016 年 9 月 28 日
26	天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报及公司官网	2016 年 10 月 26 日
27	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	中国证券报、上海证券报及公司官网	2016 年 11 月 29 日

	费率优惠活动的公告		
28	天治低碳经济灵活配置混合型 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 券报及公司官网	2016 年 12 月 1 日
29	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 券报及公司官网	2016 年 12 月 8 日
30	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 券报及公司官网	2016 年 12 月 14 日
31	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 券报及公司官网	2016 年 12 月 22 日
32	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 券报及公司官网	2016 年 12 月 29 日
33	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 券报及公司官网	2016 年 12 月 29 日
34	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、上海证券报及公司官网	2016年1月4日
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、上海证券报及公司官网	2016年1月12日
9	天治品质优选混合型证券投资	中国证券报、上海证券报及公司官网	2016年1月22日

	基金 2015 年第 4 季度报告	券报及公司官网	
10	天治品质优选混合型证券投资 基金风险分析季度报告（2015 年 4 季度）	中国证券报、上海证 券报及公司官网	2016 年 1 月 22 日
11	天治基金管理有限公司关于调 整旗下基金所持吴通控股、陆 家嘴股票估值方法的公告	中国证券报、上海证 券报及公司官网	2016 年 1 月 30 日
12	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 券报及公司官网	2016 年 2 月 3 日
13	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 券报及公司官网	2016 年 2 月 6 日
14	天治品质优选混合型证券投资 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 券报及公司官网	2016 年 2 月 19 日
15	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 券报及公司官网	2016 年 2 月 24 日
16	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 券报及公司官网	2016 年 2 月 25 日
17	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 券报及公司官网	2016 年 3 月 2 日
18	天治基金管理有限公司关于品 质优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 券报及公司官网	2016 年 3 月 15 日
19	天治公司关于以通讯方式召开	中国证券报、上海证	2016 年 3 月 15 日

	天治品质优选混合型证券投资 基金基金份额持有人大会的公 告	券报及公司官网	
20	天治基金管理有限公司关于以 通讯方式召开天治品质优选混 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	中国证券报、上海证 券报及公司官网	2016 年 3 月 15 日
21	天治基金管理有限公司更正公 告	中国证券报、上海证 券报及公司官网	2016 年 3 月 16 日
22	天治基金管理有限公司关于以 通讯方式召开天治品质优选混 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 券报及公司官网	2016 年 3 月 17 日
23	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 券报及公司官网	2016 年 3 月 25 日
24	天治品质优选混合型证券投资 基金 2015 年年度报告摘要	中国证券报、上海证 券报及公司官网	2016 年 3 月 30 日
25	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 券报及公司官网	2016 年 4 月 1 日
26	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 券报及公司官网	2016 年 4 月 8 日
27	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 券报及公司官网	2016 年 4 月 16 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低碳经济灵活配置混合型证券投资基金及天治品质优选混合型证券投资基金募集的文件
2. 《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《天治品质优选混合型证券投资基金基金合同》
3. 《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》、《天治品质优选混合型证券投资基金招募说明书》
4. 《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《天治品质优选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. 报告期内天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、天治品质优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](http://www.chinanature.com.cn)

天治基金管理有限公司  
2017 年 3 月 30 日