

# 天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 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:中信银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 27 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本基金由天治稳定收益债券型证券投资基金于2015年6月9日通过转型变更而来。

本报告期自2023年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	95
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	95
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	95
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	96
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	96

8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	96
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	96
8.12 投资组合报告附注.....	96
§9 基金份额持有人信息.....	97
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	97
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	98
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情况.....	98
§10 开放式基金份额变动.....	98
§11 重大事件揭示.....	99
11.1 基金份额持有人大会决议.....	99
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.....	99
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	99
11.4 基金投资策略的改变.....	99
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	99
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.....	100
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	100
11.8 其他重大事件.....	102
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	105
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	105
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	106
§13 备查文件目录.....	106
13.1 备查文件目录.....	106
13.2 存放地点.....	106
13.3 查阅方式.....	106

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	天治研究驱动混合	
基金主代码	350009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年06月09日	
基金管理人	天治基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	979,407,531.55份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天治研究驱动混合A	天治研究驱动混合C
下属分级基金的交易代码	350009	002043
报告期末下属分级基金的份额总额	24,998,512.99份	954,409,018.56份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过持续、系统、深入、全面的基本面研究，挖掘具有长期发展潜力和估值优势的上市公司，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将优先考虑股票类资产的配置，通过精选策略构造股票组合，剩余资产将配置于固定收益类和现金类等大类资产上。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+1年期定期存款利率(税后)×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	天治基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 姓名	姚静静	姜敏

露负责人	联系电话	021-60371155	4006800000
	电子邮箱	yaojj@chinanature.com.cn	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		400-098-4800（免长途通话费用）、021-60374800	95558
传真		021-60374934	010-85230024
注册地址		上海市徐汇区丰谷路315弄24号1-3层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		上海市云锦路701号西岸智塔东塔19楼	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200232	100020
法定代表人		马铁刚	方合英

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区世纪大道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	上海市云锦路701号西岸智塔东塔19楼

## §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

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指</b>	2023年	2022年	2021年
---------------------	-------	-------	-------

标	天治研究驱动混合A	天治研究驱动混合C	天治研究驱动混合A	天治研究驱动混合C	天治研究驱动混合A	天治研究驱动混合C
本期已实现收益	-1,814,25 1.59	3,270,76 3.25	-10,793,9 70.73	-4,353,8 62.00	27,000,2 01.08	13,862,7 78.97
本期利润	267,318. 28	4,131,35 5.16	-21,324,4 26.56	-8,295,6 98.97	3,691,81 7.84	1,068,68 5.34
加权平均基金份额 本期利润	0.0092	0.0395	-1.1823	-1.0443	0.1042	0.0640
本期加权平均净值 利润率	0.42%	2.13%	-56.03%	-55.72%	3.90%	2.64%
本期基金份额净值 增长率	12.61%	12.88%	-31.50%	-30.94%	2.30%	1.92%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2023年末		2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	8,932,79 6.69	309,390, 587.72	12,510,8 43.17	6,519,61 6.66	45,978,9 30.01	7,616,12 3.49
期末可供分配基金 份额利润	0.3573	0.3242	0.7661	0.6088	1.3841	1.1494
期末基金资产净值	37,287,4 15.78	1,386,02 2,476.52	28,841,1 20.41	17,228,3 20.71	85,625,2 35.68	15,440,9 32.51
期末基金份额净值	1.4916	1.4522	1.766	1.609	2.578	2.330
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2023年末		2022年末		2021年末	
基金份额累计净值 增长率	83.29%	66.93%	62.76%	47.89%	137.60%	114.15%

- 1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天治研究驱动混合A

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	-0.81%	1.02%	-4.06%	0.47%	3.25%	0.55%
过去六个月	-19.94%	1.32%	-6.26%	0.51%	-13.68%	0.81%
过去一年	12.61%	1.91%	-6.44%	0.51%	19.05%	1.40%
过去三年	-21.08%	1.90%	-22.12%	0.67%	1.04%	1.23%
过去五年	101.08%	1.72%	11.16%	0.73%	89.92%	0.99%
自基金合同生效起至今	83.29%	1.38%	11.97%	0.58%	71.32%	0.80%

天治研究驱动混合C

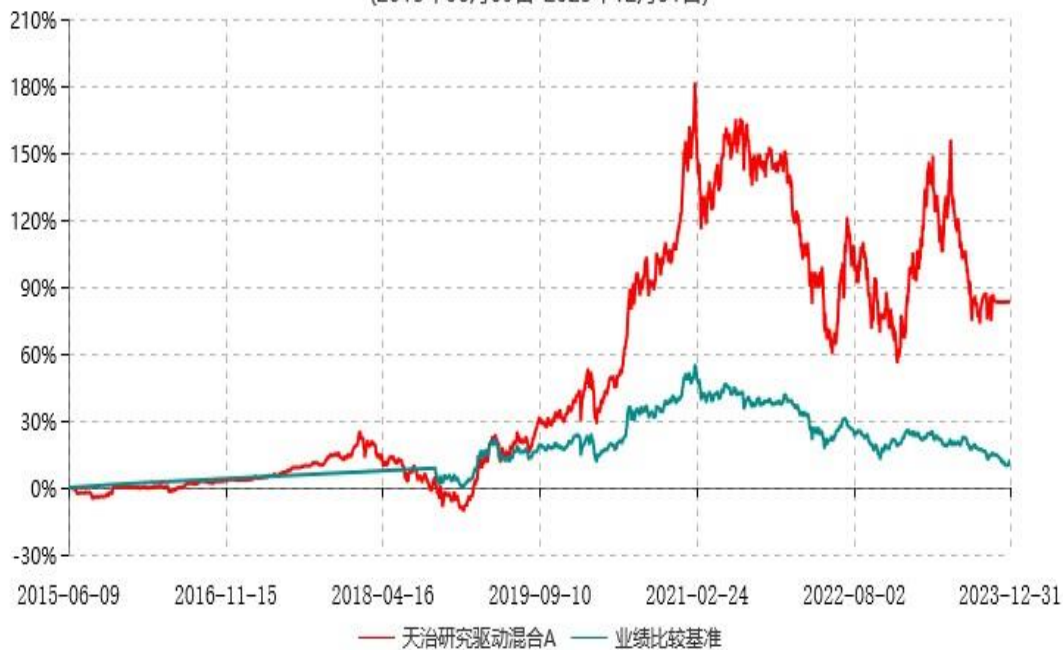
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.86%	1.02%	-4.06%	0.47%	3.20%	0.55%
过去六个月	-19.99%	1.32%	-6.26%	0.51%	-13.73%	0.81%
过去一年	12.88%	1.91%	-6.44%	0.51%	19.32%	1.40%
过去三年	-20.55%	1.90%	-22.12%	0.67%	1.57%	1.23%
过去五年	101.14%	1.72%	11.16%	0.73%	89.98%	0.99%
自基金合同生效起至今	66.93%	1.42%	10.53%	0.59%	56.40%	0.83%

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



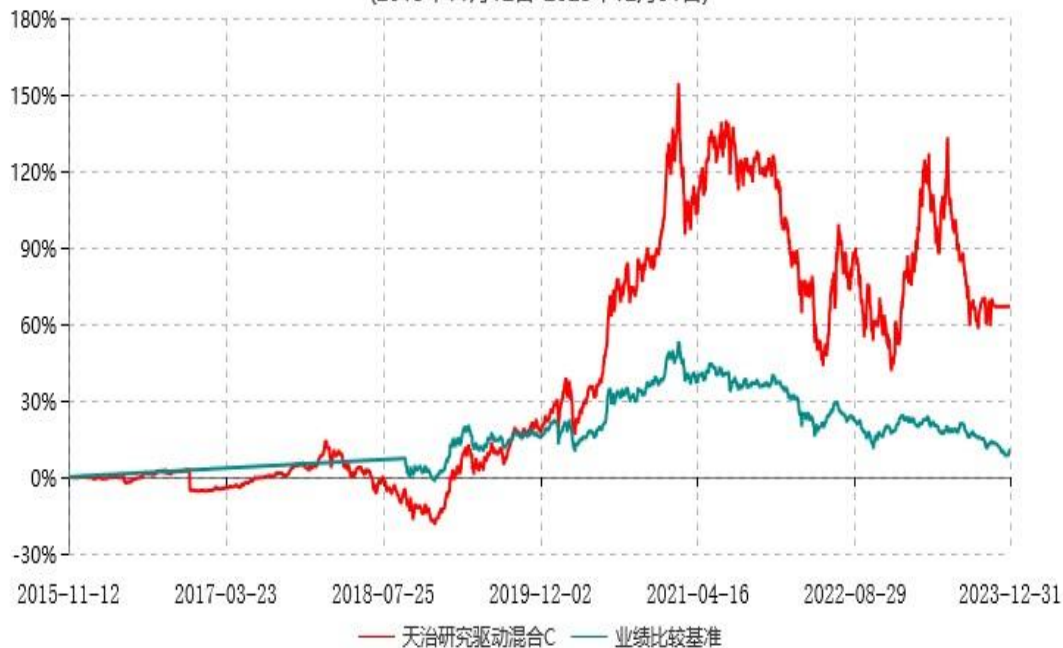
天治研究驱动混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年06月09日-2023年12月31日)



天治研究驱动混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年11月12日-2023年12月31日)



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

天治研究驱动混合A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023年	4.970	9,727,924.72	2,028,099.20	11,756,023.92	-
合计	4.970	9,727,924.72	2,028,099.20	11,756,023.92	-

天治研究驱动混合C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023年	3.640	346,842,786.28	451,474.17	347,294,260.45	-
合计	3.640	346,842,786.28	451,474.17	347,294,260.45	-

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人--天治基金管理有限公司于2003年5月成立，注册资本1.6亿元，注册地为上海。公司股权结构为：吉林省信托有限责任公司出资9800万元，占注册资本的61.25%；中国吉林森林工业集团有限责任公司出资6200万元，占注册资本的38.75%。截至2023年12月31日，本基金管理人旗下共有十五只开放式基金，除本基金外，另外十四只基金--天治财富增长证券投资基金、天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）、天治天得利货币市场基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、天治可转债增强债券型证券投资基金、天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金（转型自2008年5月8日生效的天治创新先锋混合型证券投资基金）、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金（转型自2005年1月12日生效的天治品质优选混合型证券投资基金）、天治新消费灵活配置混合型证券投资基金（转型自2011年8月4日生效的天治成长精选混合型证券投资基金）、天治鑫利纯债债券型证券投资基金（转型自2016年12月7日生效的天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金）、天治转型升级混合型证券投资基金、天治量化核心精选混合型证券投资基金、天治天享66个月定期开放债券型证券投资基金、天治鑫祥利率债债券型证券投资基金分别于2004年6月29日、2006年1月20日、2006年7月5日、2008年11月5日、2009年7月15日、2013年6月4日、2016年4月7日、2016年4月18日、2016年7月6日、2019年3月7日、2019年5月21日、2019年6月11日、2021年9月16日、2023年7月10日生效。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
许家涵	公司总经理、财务负责人兼投资总监、本基金基金经理、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天治稳健双盈债券型证券投资基金基金经理、天治量化核心精选混合型证券投资基金基金经理	2022-04-06	-	18年	经济学、文学双学士，具有基金从业资格。2005年7月至2007年9月就职于吉林省信托有限责任公司任自营资金部职员，2007年9月至今就职于天治基金管理有限公司，曾任交易员、交易部总监助理、交易部副总监、交易部总监、权益投资部总监、副总经理
梁莉	研究发展部副总监、本基金基金经理、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天治新消费灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2023-11-23	-	12年	硕士研究生，具有基金从业资格。2011年5月至2015年6月于东北证券上海研究咨询分公司任研究员。2015年7月加入天治基金管理有限公司，曾任研究发展部研究员、专户投资部投资经理。

注：1、基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离任日期为公司对外公告的离任日期；非首任基金经理，任职日期和离任日期分别为公司对外公告的任职日期和离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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向交易的交易价差进行分析。

具体方法如下：

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

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

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

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

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

首先来看宏观，在基金经理的投资框架里，宏观研判放在首位。因为宏观政策对A股市场的方向指引影响较大，重视宏观研判，首先能做到大的方向上不出现偏差，其次在行业布局和选择上也能做到紧跟政策、顺势而为。宏观方面，基金经理主要关注五个方向、“三驾马车”--投资、消费、出口、叠加汇率和货币政策。“三驾马车”主要侧重国内经济分析、汇率侧重海外联动、货币政策主要研判流动性。基金经理认为这五个方面，三个正向，市场震荡偏强；四个以上正向，趋势性上涨；反之亦然，调整的可能性大。

2023年受前期疫情影响，居民风险偏好和消费倾向较低，整体消费水平和疫情前仍有较大差距。投资端，基建投资维持相对高位，制造业投资小幅回落，房地产融资端和需求端低迷，地产投资大幅下滑。海外经济下行和去库存背景下，出口高位回落。美债利率高位、国内经济偏弱情形下，汇率承压；流动性方面，货币政策保持稳健偏宽。五

个指标中仅流动性指标正向，叠加资金流出存量博弈，因此市场偏弱，主要以结构性行情为主。2023年A股主要指数整体下跌，其中创业板跌幅较大，上证指数小幅下跌。申万行业中，通信、传媒、计算机和电子涨幅居前，美容护理、商贸零售、房地产和电力设备跌幅较大。美联储加息暂停和美国经济好于预期情形下，海外主要股指均大幅上涨，其中纳斯达克指数涨幅居前。12月11日中央经济工作会议强调以经济建设为中心，除政治局会议所强调的“稳中求进、以进促稳、先立后破”之外，会议进一步指出“多出有利于稳预期、稳增长、稳就业的政策”。总体来看，中国式现代化和高质量发展仍是国内政策制定和经济发展的核心目标。

基金操作层面，2023年研究驱动基金阶段性取得了较好的收益，但也经历了阶段性较大幅度的回撤。为了更好地控制回撤、降低波动率、锁定收益，研究驱动基金在2023年12月调整投资策略：加强绝对收益思维，阶段性选择降低权益仓位，加大固收仓位的投资策略。待2024年权益市场方向明确，再择机选择加仓。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末天治研究驱动混合A基金份额净值为1.4916元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.61%，同期业绩比较基准收益率为-6.44%；截至报告期末天治研究驱动混合C基金份额净值为1.4522元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.88%，同期业绩比较基准收益率为-6.44%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024年，国内基本面最差的时期基本已过，本轮库存周期底部基本确立，逆周期政策持续出台有望扭转市场悲观预期。海外美联储降息情形下流动性环境有望好转，A股市场估值整体处于低位，权益资产投资性价比凸显。看好供给格局优化、需求改善空间大、符合经济结构转型导向、估值足够便宜、盈利具有爆发性、具备周期或成长特征的行业和标的。

2024年我们最看好的行业是卫星互联网行业，我们正在加紧研究、紧密跟踪。看好理由如下：空间卫星轨道和频段具有稀缺性，我国星网总规划为1.29万颗卫星，低轨卫星进入密集部署期。美国在低轨卫星具有先发优势，我国将加速跟进。国新办、工信部以及上海市等均表态政策支持卫星互联网发展。目前，中国卫星互联网行业仍处于初级发展阶段，但由于下游需求旺盛且商业航天的参与可以实现卫星产业的“自我造血”。随着手机直连卫星、车载卫星互联网、机载及船载卫星互联网应用持续落地，卫星互联网下游应用有望迎来蓬勃发展。这将进一步推动上游星座组网加速，形成上下游产业的良性互动，预示着产业的爆发即将来临。短期，新机发布和产业链补库带来消费电子需求边际改善。往后看，AI加速手机和PC需求增长，随着AI渗透带来新的应用场景和需求。2024年将成为AI PC规模性出货元年，智能手机品牌纷纷接入或拥抱大模型。伴随AI应

用落地扩容，算力投资有望与应用生态共振爆发。AI引领技术革命，全球算力竞赛开启，美国GPU禁运将加快算力国产化进程。当前人形机器人仍处于从0到1的阶段，机器人的发展趋势已从自动化转向智能化，而AI技术是迈向通用智能人形机器人的关键技术之一。短期商业化进程有望加速，长期成长空间广阔。2023年10月，《人形机器人创新发展指导意见》明确了人形机器人发展的两个阶段的目标。人形机器人各方面的技术储备已经达到行业快速发展的临界点，国产核心零部件厂商有望受益。

当前工业金属铜和铝库存处于历史低位，通胀降温、美联储2024年降息情形下，美债利率和美元指数下行将从金融属性催化铜铝上涨。工业属性角度，随着国内稳增长政策发力、地产需求修复以及中美制造业改善，供需偏紧的情形下铜铝价格有较大的上行空间。看好航空板块投资机会，供给方面，民航新增运力有限，2024年我国客运机队增速将继续维持低个位数。需求端，随着出境政策加速放宽，国际航空出行需求还将进一步回暖，航空板块盈利中枢将显著提升。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023年，本基金管理人持续依照法律法规规定和公司内控制度要求独立开展监察稽核工作，通过现场检查、系统实时监控、人员询问、重点抽查等方式，监督本基金运作相关的内控制度建设及各项制度执行情况，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、基金结算及人事管理等业务环节。

本基金管理人内部监察稽核发现：

一、报告期内，本基金管理人持续更新、完善了内部控制体系，制定或修订了多项内部控制制度，有效保障了公司相关机构职能的发挥及业务的发展，本基金管理人的内部控制体系覆盖了本基金运作的所有环节。

二、报告期内，监察稽核过程中未发现本基金运作过程存在重大违反法律法规、内部控制制度的情况，各项相关制度均能有效执行，本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旗下基金运作的检查监督，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。

#### 4.7 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分管基金运营的分管领导、投资总监、研究发展部总监、权益投资部总监、固定收益部总监、基金结算部总监、监察稽核部总监、产品开发与金融工程部总监等，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对于权益投资部、固定收益部及产品开发与金融工程部提交的估值模型和估值结果进行论证审核，并签署最终意见。基金经理会参与估值，与产品开发与金融工程部一同根据估值模型、估值程序计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，将估值结果提交公司估值委员会。

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

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期实施利润分配1次，符合相关法规及基金合同的规定。详见7.4.11利润分配情况。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### **§5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金2023年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，天治基金管理有限公司在天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了

《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，天治基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2023年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

### 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（2024）审字第70015648_B14号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于天治研究驱动灵活配置混合型证

	券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作

	<p>出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制，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。(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
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）	
注册会计师的姓名	石静筠	骆文慧
会计师事务所的地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼	

审计报告日期	2024-03-22
--------	------------

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	9,954,693.32	3,074,696.60
结算备付金		281,717,960.86	747,044.77
存出保证金		364,166.57	54,659.40
交易性金融资产	7.4.7.2	842,628,699.00	42,824,699.00
其中：股票投资		811,435.00	42,824,699.00
基金投资		-	-
债券投资		841,817,264.00	-
资产支持证券投 资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	291,088,515.91	-
应收清算款		-	2,165,814.66
应收股利		-	-
应收申购款		22,194.49	231,292.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,425,776,230.15	49,098,206.62
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2023年12月31日	2022年12月31日
<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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		55,084.00	2,471,670.00
应付管理人报酬		1,027,897.05	33,265.05
应付托管费		256,974.25	8,316.26
应付销售服务费		248,754.26	3,365.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	877,628.29	512,148.69
负债合计		2,466,337.85	3,028,765.50
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	979,407,531.55	27,038,981.29
未分配利润	7.4.7.8	443,902,360.75	19,030,459.83
净资产合计		1,423,309,892.30	46,069,441.12
负债和净资产总计		1,425,776,230.15	49,098,206.62

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额净值1.4532元，基金份额总额979,407,531.55份。其中A类基金份额净值1.4916元，份额总额24,998,512.99份；C类基金份额净值1.4522元，份额总额954,409,018.56份。

## 7.2 利润表

会计主体：天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2023年01月01日至2 023年12月31日	2022年01月01日至2 022年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		7,362,853.14	-28,822,594.43
1.利息收入		1,728,666.95	29,697.19
其中：存款利息收入	7.4.7.9	780,273.95	29,697.19
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		948,393.00	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		1,336,438.68	-14,970,411.34
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-668,739.41	-15,055,612.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,177,791.19	73,617.10
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	827,386.90	11,584.23
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.16	2,942,161.78	-14,472,292.80
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.17	1,355,585.73	590,412.52
<b>减：二、营业总支出</b>		2,964,179.70	797,531.10
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,979,776.20	425,977.54
2.托管费	7.4.10.2.2	494,944.01	106,494.41

3.销售服务费	7.4.10.2.3	367,368.18	29,375.91
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	39,894.19
其中：卖出回购金融资产支出		-	39,894.19
6.信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	0.18
8.其他费用	7.4.7.19	122,091.31	195,788.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,398,673.44	-29,620,125.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,398,673.44	-29,620,125.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,398,673.44	-29,620,125.53

### 7.3 净资产变动表

会计主体：天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	27,038,981.29	19,030,459.83	46,069,441.12
二、本期期初净资产	27,038,981.29	19,030,459.83	46,069,441.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	952,368,550.26	424,871,900.92	1,377,240,451.18
（一）、综合收益	-	4,398,673.44	4,398,673.44



总额			
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	952,368,550.26	779,523,511.85	1,731,892,062.11
其中: 1.基金申购款	1,149,729,184.34	1,011,105,016.06	2,160,834,200.40
2.基金赎回款	-197,360,634.08	-231,581,504.21	-428,942,138.29
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-359,050,284.37	-359,050,284.37
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	979,407,531.55	443,902,360.75	1,423,309,892.30
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	39,845,380.33	61,220,787.86	101,066,168.19
二、本期期初净资产	39,845,380.33	61,220,787.86	101,066,168.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,806,399.04	-42,190,328.03	-54,996,727.07
(一)、综合收益总额	-	-29,620,125.53	-29,620,125.53
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产	-12,806,399.04	-12,570,202.50	-25,376,601.54

产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	80,324,610.18	82,372,701.20	162,697,311.38
2.基金赎回款	-93,131,009.22	-94,942,903.70	-188,073,912.92
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	27,038,981.29	19,030,459.83	46,069,441.12

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：

许家涵

赵正中

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

天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由天治稳定收益债券型证券投资基金转型而来，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]1379号文《关于核准天治稳定收益债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人天治基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2011年12月28日正式生效，首次设立募集规模为220,605,000.90份基金份额。经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]791号《关于准予天治稳定收益债券型证券投资基金变更注册的批复》的核准，并经天治稳定收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，自2015年6月9日起，天治稳定收益债券型证券投资基金转型为混合型基金，《天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《天治稳定收益债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金类别分为A类及C类基金份额。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。

本基金为契约型，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为天治基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券等固定收益类资产（包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、短期公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具）、股指期货与权证等金融衍生工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为0%-95%。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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率×60%+1年期定期存款利率（税后）×40%。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第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<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 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2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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和金融负债，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整

个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中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小层次输入值，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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 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) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；根据财政部、税务总局公告2023年



第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 7.4.6.4 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	9,954,693.32	3,074,696.60

等于：本金	9,939,322.67	3,074,081.87
加：应计利息	15,370.65	614.73
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	9,954,693.32	3,074,696.60

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	932,438.36	-	811,435.00	-121,003.36	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	838,581,450.00	3,133,264.00	841,817,264.00	102,550.00
	合计	838,581,450.00	3,133,264.00	841,817,264.00	102,550.00
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	839,513,888.36	3,133,264.00	842,628,699.00	-18,453.36
项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	45,785,314.14	-	42,824,699.00	-2,960,615.14
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	45,785,314.14	-	42,824,699.00	-2,960,615.14

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	291,088,515.91	-
合计	291,088,515.91	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	59.01	30.61
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	800,080.46	354,629.26
其中：交易所市场	782,162.89	354,629.26
银行间市场	17,917.57	-
应付利息	-	-
预提信息披露费	50,000.00	120,000.00
预提审计费	25,000.00	35,000.00
其他	2,488.82	2,488.82
合计	877,628.29	512,148.69

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 天治研究驱动混合A

金额单位：人民币元

项目 (天治研究驱动混合A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	16,330,277.24	16,330,277.24
本期申购	56,062,154.25	56,062,154.25
本期赎回（以“-”号填列）	-47,393,918.50	-47,393,918.50
本期末	24,998,512.99	24,998,512.99

#### 7.4.7.7.2 天治研究驱动混合C

金额单位：人民币元

项目 (天治研究驱动混合C)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,708,704.05	10,708,704.05
本期申购	1,093,667,030.09	1,093,667,030.09
本期赎回（以“-”号填列）	-149,966,715.58	-149,966,715.58
本期末	954,409,018.56	954,409,018.56

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 天治研究驱动混合A

单位：人民币元

项目 (天治研究驱动混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,798,742.23	-2,287,899.06	12,510,843.17
本期期初	14,798,742.23	-2,287,899.06	12,510,843.17
本期利润	-1,814,251.59	2,081,569.87	267,318.28
本期基金份额交易产生的变动数	7,704,329.97	3,562,435.29	11,266,765.26
其中：基金申购款	60,195,475.94	14,464,609.10	74,660,085.04
基金赎回款	-52,491,145.97	-10,902,173.81	-63,393,319.78
本期已分配利润	-11,756,023.92	-	-11,756,023.92
本期末	8,932,796.69	3,356,106.10	12,288,902.79

##### 7.4.7.8.2 天治研究驱动混合C

单位：人民币元

项目 (天治研究驱动混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,822,833.38	-1,303,216.72	6,519,616.66
本期期初	7,822,833.38	-1,303,216.72	6,519,616.66
本期利润	3,270,763.25	860,591.91	4,131,355.16
本期基金份额交易产生的变动数	645,591,251.54	122,665,495.05	768,256,746.59
其中：基金申购款	782,618,559.47	153,826,371.55	936,444,931.02
基金赎回款	-137,027,307.93	-31,160,876.50	-168,188,184.43
本期已分配利润	-347,294,260.45	-	-347,294,260.45
本期末	309,390,587.72	122,222,870.24	431,613,457.96

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	194,202.04	23,494.99
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	581,594.86	5,376.08
其他	4,477.05	826.12
合计	780,273.95	29,697.19

## 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	2,833,427,685.41	405,108,676.40
减：卖出股票成本总额	2,825,960,774.78	418,967,831.92

减：交易费用	8,135,650.04	1,196,457.15
买卖股票差价收入	-668,739.41	-15,055,612.67

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	1,212,291.19	56,026.53
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-34,500.00	17,590.57
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	1,177,791.19	73,617.10

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券(债转股 及债券到期兑付) 成交总额	299,074,983.81	19,574,256.59
减：卖出债券(债 转股及债券到期兑 付)成本总额	298,740,740.00	19,185,133.00
减：应计利息总额	363,243.81	371,515.89
减：交易费用	5,500.00	17.13



买卖债券差价收入	-34,500.00	17,590.57
----------	------------	-----------

#### 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益--赎回差价收入。

#### 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益--申购差价收入。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

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。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

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 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

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。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
股票投资产生的股利收益	827,386.90	11,584.23
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	827,386.90	11,584.23

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	2,942,161.78	-14,472,292.80
——股票投资	2,839,611.78	-14,519,692.80
——债券投资	102,550.00	47,400.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	2,942,161.78	-14,472,292.80

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
基金赎回费收入	1,344,364.86	589,156.36
基金转换费收入	11,220.87	1,256.16
合计	1,355,585.73	590,412.52

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
审计费用	25,000.00	35,000.00
信息披露费	50,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	10,891.31	4,788.87
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	200.00	-
合计	122,091.31	195,788.87

## 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

根据本基金管理人于2024年1月24日发布的分红公告，本基金向2024年1月25日在本基金注册登记机构登记在册的A类基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.739元，C类基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.719元。

根据本基金管理人于2024年2月27日发布的分红公告，本基金向2024年2月28日在本基金注册登记机构登记在册的C类基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.677元。

截至财务报表批准日，除上述事项外，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
中信银行股份有限公司	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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 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**

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 权证交易**

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权证交易。

**7.4.10.1.3 债券交易**

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债券交易。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

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债券回购交易。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**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 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,979,776.20	425,977.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	473,755.88	123,834.87
应支付基金管理人的净管理费	1,506,020.32	302,142.67

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3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	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	494,944.01	106,494.41

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天治研究驱动混合A	天治研究驱动混合C	合计
天治基金管理有限公司	0.00	172,572.27	172,572.27
合计	0.00	172,572.27	172,572.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天治研究驱动混合A	天治研究驱动混合C	合计
天治基金管理有限公司	0.00	2,770.59	2,770.59
合计	0.00	2,770.59	2,770.59

注：A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额销售服务费年费率为0.20%。本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.2%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times \text{C类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给各销售机构，或一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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
中信银行	9,954,693.32	194,202.04	3,074,696.60	23,494.99

股份有限 公司				
------------	--	--	--	--

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

天治研究驱动混合A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2023-1 2-28	2023-12-2 8	4.970	9,727,92 4.72	2,028,099.2 0	11,756,02 3.92	-
合计			4.970	9,727,92 4.72	2,028,099.2 0	11,756,02 3.92	-

天治研究驱动混合C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2023-1 2-28	2023-12-2 8	3.640	346,842,7 86.28	451,474.17	347,294,2 60.45	-
合计			3.640	346,842,7 86.28	451,474.17	347,294,2 60.45	-

#### 7.4.12 期末（2023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

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等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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2023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金融资产款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023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金融资产款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

### 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。本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下设的合规与风险控制委员会、督察长、经营管理层下设的风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部及各个业务部门组成。

#### 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同责任，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。本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

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。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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



#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 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

单位：人民币元

本期末 2023年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	9,954,693.32	-	-	-	-	-	9,954,693.32

天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金2023年年度报告

结算备付金	281,717,960.86	-	-	-	-	-	281,717,960.86
存出保证金	364,166.57	-	-	-	-	-	364,166.57
交易性金融资产	841,817,264.00	-	-	-	-	811,435.00	842,628,699.00
买入返售金融资产	291,088,515.91	-	-	-	-	-	291,088,515.91
应收申购款	-	-	-	-	-	22,194.49	22,194.49
资产总计	1,424,942,600.66	-	-	-	-	833,629.49	1,425,776,230.15
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	55,084.00	55,084.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,027,897.05	1,027,897.05
应付托管费	-	-	-	-	-	256,974.25	256,974.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	248,754.26	248,754.26
其他负债	-	-	-	-	-	877,628.29	877,628.29
负债总计	-	-	-	-	-	2,466,337.85	2,466,337.85
利率敏感度缺口	1,424,942,600.66	-	-	-	-	-1,632,708.36	1,423,309,892.30
上年度末 2022年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	3,074,696.60	-	-	-	-	-	3,074,696.60
结算备付金	747,044.77	-	-	-	-	-	747,044.77

存出保证金	54,659.40	-	-	-	-	-	54,659.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	42,824,699.00	42,824,699.00
应收清算款	-	-	-	-	-	2,165,814.66	2,165,814.66
应收申购款	-	-	-	-	-	231,292.19	231,292.19
资产总计	3,876,400.77	-	-	-	-	45,221,805.85	49,098,206.62
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,471,670.00	2,471,670.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,265.05	33,265.05
应付托管费	-	-	-	-	-	8,316.26	8,316.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,365.50	3,365.50
其他负债	-	-	-	-	-	512,148.69	512,148.69
负债总计	-	-	-	-	-	3,028,765.50	3,028,765.50
利率敏感度缺口	3,876,400.77	-	-	-	-	42,193,040.35	46,069,441.12

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

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	利率上升25个基点	-76,807.71	0.00

	利率下降25个基点	76,807.71	0.00
--	-----------	-----------	------

注：本基金上年度末未持有债券资产，故无利率风险。

#### 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 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	811,435.00	0.06	42,824,699.00	92.96
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	811,435.00	0.06	42,824,699.00	92.96
----	------------	------	---------------	-------

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	98,147,979.26	2,527,712.94
	业绩比较基准变动-5%	-98,147,979.26	-2,527,712.94

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	811,435.00	42,824,699.00
第二层次	841,817,264.00	-
第三层次	-	-
合计	842,628,699.00	42,824,699.00

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投

资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,493,943.84	1,493,943.84
当期购买	-	-	-

当期出售/结算	-	1,183,313.18	1,183,313.18
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	219,086.61	219,086.61
当期利得或损失总额	-	-91,544.05	-91,544.05
其中：计入损益的利得或损失	-	-91,544.05	-91,544.05
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

本基金本报告期及上年度末无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 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。

##### 7.4.15.2 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。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2024年03月22日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

## 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	811,435.00	0.06
	其中：股票	811,435.00	0.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	841,817,264.00	59.04
	其中：债券	841,817,264.00	59.04
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	291,088,515.91	20.42
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	291,672,654.18	20.46
8	其他各项资产	386,361.06	0.03
9	合计	1,425,776,230.15	100.00

## 8.2 报告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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	462,443.00	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-



H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	348,992.00	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	811,435.00	0.06

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300366	创意信息	26,600	348,992.00	0.02
2	603305	旭升集团	16,600	327,518.00	0.02
3	002465	海格通信	10,500	134,925.00	0.01

### 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	600536	中国软件	31,886,282.09	69.21
2	002368	太极股份	27,342,418.07	59.35
3	000032	深桑达 A	26,541,675.04	57.61
4	300624	万兴科技	23,886,171.00	51.85
5	688031	星环科技	23,579,566.88	51.18
6	300212	易华录	23,089,494.35	50.12
7	002230	科大讯飞	21,166,426.00	45.94
8	688256	寒武纪	20,602,899.65	44.72
9	600602	云赛智联	19,793,847.00	42.97
10	688111	金山办公	19,688,975.75	42.74
11	600941	中国移动	19,267,539.00	41.82
12	300033	同花顺	19,000,588.00	41.24
13	300058	蓝色光标	18,936,077.82	41.10
14	300226	上海钢联	18,734,192.00	40.67
15	002912	中新赛克	18,236,466.13	39.58
16	601728	中国电信	17,965,872.00	39.00
17	300496	中科创达	17,520,579.00	38.03
18	300418	昆仑万维	17,075,930.30	37.07
19	000977	浪潮信息	16,335,483.73	35.46
20	688012	中微公司	16,072,911.52	34.89
21	002777	久远银海	15,694,370.84	34.07
22	300188	美亚柏科	15,338,186.62	33.29
23	003029	吉大正元	15,112,715.86	32.80
24	300366	创意信息	14,824,528.00	32.18
25	688095	福昕软件	14,690,908.79	31.89
26	000034	神州数码	14,685,177.28	31.88
27	300308	中际旭创	14,683,307.20	31.87
28	601138	工业富联	14,415,842.00	31.29
29	603019	中科曙光	14,197,249.00	30.82
30	300394	天孚通信	14,001,392.84	30.39
31	000021	深科技	13,927,893.00	30.23

32	601390	中国中铁	13,670,712.00	29.67
33	300364	中文在线	13,038,417.14	28.30
34	600050	中国联通	12,922,480.00	28.05
35	601360	三六零	12,857,579.26	27.91
36	688041	海光信息	12,737,339.48	27.65
37	002908	德生科技	12,673,556.90	27.51
38	600839	四川长虹	12,477,565.93	27.08
39	000066	中国长城	12,384,847.99	26.88
40	300459	汤姆猫	12,382,449.00	26.88
41	601601	中国太保	12,086,344.00	26.24
42	600584	长电科技	11,913,470.00	25.86
43	601628	中国人寿	11,897,368.00	25.82
44	688327	云从科技	11,830,476.40	25.68
45	300002	神州泰岳	11,772,251.86	25.55
46	300604	长川科技	11,713,016.00	25.42
47	603000	人民网	11,629,546.94	25.24
48	002351	漫步者	11,489,101.00	24.94
49	300031	宝通科技	11,446,267.00	24.85
50	002156	通富微电	11,367,343.00	24.67
51	601318	中国平安	11,343,029.76	24.62
52	002409	雅克科技	11,154,584.20	24.21
53	601800	中国交建	11,128,263.00	24.16
54	601111	中国国航	10,977,246.00	23.83
55	300474	景嘉微	10,915,026.00	23.69
56	688579	山大地纬	10,864,036.35	23.58
57	601186	中国铁建	10,847,730.00	23.55
58	000933	神火股份	10,684,819.00	23.19
59	688110	东芯股份	10,647,395.01	23.11
60	688362	甬矽电子	10,619,335.98	23.05
61	603496	恒为科技	10,586,677.62	22.98
62	688201	信安世纪	10,562,215.68	22.93

63	688498	源杰科技	10,360,243.64	22.49
64	688066	航天宏图	10,353,061.20	22.47
65	000928	中钢国际	10,262,143.00	22.28
66	688365	光云科技	9,977,836.64	21.66
67	301236	软通动力	9,933,540.36	21.56
68	601899	紫金矿业	9,853,613.47	21.39
69	605168	三人行	9,817,835.98	21.31
70	301269	华大九天	9,645,265.99	20.94
71	300659	中孚信息	9,638,019.28	20.92
72	603888	新华网	9,549,335.08	20.73
73	600519	贵州茅台	9,436,151.00	20.48
74	300687	赛意信息	9,409,630.32	20.42
75	601021	春秋航空	9,397,866.08	20.40
76	688008	澜起科技	9,168,058.41	19.90
77	688787	海天瑞声	9,117,147.44	19.79
78	300229	拓尔思	9,116,747.03	19.79
79	300502	新易盛	8,952,181.60	19.43
80	688766	普冉股份	8,859,655.00	19.23
81	002123	梦网科技	8,844,085.00	19.20
82	002261	拓维信息	8,778,163.58	19.05
83	002236	大华股份	8,667,858.00	18.81
84	601995	中金公司	8,664,477.57	18.81
85	688246	嘉和美康	8,608,590.62	18.69
86	300130	新国都	8,596,696.40	18.66
87	002315	焦点科技	8,533,802.00	18.52
88	600850	电科数字	8,507,833.30	18.47
89	600011	华能国际	8,463,152.00	18.37
90	002941	新疆交建	8,352,029.00	18.13
91	688372	伟测科技	8,221,092.92	17.85
92	300476	胜宏科技	8,061,138.00	17.50
93	000988	华工科技	7,988,916.08	17.34

94	603444	吉比特	7,935,842.00	17.23
95	688120	华海清科	7,926,414.38	17.21
96	603885	吉祥航空	7,916,285.87	17.18
97	300251	光线传媒	7,760,715.00	16.85
98	002555	三七互娱	7,755,782.00	16.83
99	600958	东方证券	7,715,775.96	16.75
100	001309	德明利	7,690,624.00	16.69
101	600642	申能股份	7,671,114.00	16.65
102	002605	姚记科技	7,651,185.00	16.61
103	002517	恺英网络	7,620,534.00	16.54
104	301308	江波龙	7,522,326.40	16.33
105	300548	博创科技	7,515,991.00	16.31
106	603501	韦尔股份	7,456,662.99	16.19
107	601336	新华保险	7,455,026.00	16.18
108	600048	保利发展	7,425,470.07	16.12
109	600029	南方航空	7,419,671.00	16.11
110	301169	零点有数	7,413,804.60	16.09
111	601117	中国化学	7,408,144.00	16.08
112	688072	拓荆科技	7,406,356.49	16.08
113	000543	皖能电力	7,369,986.00	16.00
114	300996	普联软件	7,351,082.00	15.96
115	300170	汉得信息	7,341,793.00	15.94
116	001311	多利科技	7,312,568.69	15.87
117	600809	山西汾酒	7,277,615.45	15.80
118	600970	中材国际	7,203,006.00	15.64
119	300567	精测电子	7,202,082.00	15.63
120	002463	沪电股份	7,157,184.13	15.54
121	300054	鼎龙股份	7,154,519.00	15.53
122	002544	普天科技	7,146,858.00	15.51
123	600977	中国电影	7,134,361.00	15.49
124	603383	顶点软件	7,127,039.00	15.47

125	301153	中科江南	7,038,895.60	15.28
126	000568	泸州老窖	6,995,922.00	15.19
127	600633	浙数文化	6,966,496.85	15.12
128	300766	每日互动	6,942,461.44	15.07
129	002531	天顺风能	6,927,442.85	15.04
130	300494	盛天网络	6,895,955.00	14.97
131	002487	大金重工	6,826,810.00	14.82
132	300443	金雷股份	6,797,512.00	14.75
133	601600	中国铝业	6,687,148.00	14.52
134	002987	京北方	6,685,801.00	14.51
135	688153	唯捷创芯	6,676,040.67	14.49
136	603986	兆易创新	6,672,355.00	14.48
137	000065	北方国际	6,539,821.00	14.20
138	688001	华兴源创	6,521,097.19	14.15
139	603005	晶方科技	6,516,217.57	14.14
140	600023	浙能电力	6,445,142.00	13.99
141	002446	盛路通信	6,418,644.00	13.93
142	600667	太极实业	6,417,880.00	13.93
143	688047	龙芯中科	6,309,043.37	13.69
144	300315	掌趣科技	6,268,268.46	13.61
145	603918	金桥信息	6,203,817.00	13.47
146	300129	泰胜风能	6,174,083.00	13.40
147	002609	捷顺科技	6,145,417.00	13.34
148	000807	云铝股份	6,134,219.00	13.32
149	300762	上海瀚讯	6,132,636.00	13.31
150	688258	卓易信息	6,088,886.71	13.22
151	688123	聚辰股份	6,043,255.73	13.12
152	600383	金地集团	6,041,321.00	13.11
153	300750	宁德时代	6,038,799.60	13.11
154	002063	远光软件	6,012,540.84	13.05
155	001979	招商蛇口	5,999,000.00	13.02

156	300136	信维通信	5,959,880.76	12.94
157	301155	海力风电	5,893,195.70	12.79
158	000776	广发证券	5,886,410.06	12.78
159	605222	起帆电缆	5,826,190.00	12.65
160	300592	华凯易佰	5,824,245.00	12.64
161	300133	华策影视	5,823,246.00	12.64
162	002558	巨人网络	5,747,540.00	12.48
163	601377	兴业证券	5,729,653.80	12.44
164	300458	全志科技	5,728,995.00	12.44
165	688798	艾为电子	5,697,784.94	12.37
166	000858	五粮液	5,693,356.00	12.36
167	605289	罗曼股份	5,690,076.00	12.35
168	600325	华发股份	5,571,842.00	12.09
169	603606	东方电缆	5,512,694.99	11.97
170	300075	数字政通	5,489,651.00	11.92
171	300250	初灵信息	5,482,367.00	11.90
172	600105	永鼎股份	5,464,842.32	11.86
173	300223	北京君正	5,447,395.30	11.82
174	603636	南威软件	5,436,027.85	11.80
175	601668	中国建筑	5,429,039.00	11.78
176	603650	彤程新材	5,427,303.00	11.78
177	300738	奥飞数据	5,412,692.04	11.75
178	600115	中国东航	5,408,011.00	11.74
179	688608	恒玄科技	5,377,090.33	11.67
180	002599	盛通股份	5,370,059.30	11.66
181	300036	超图软件	5,369,382.41	11.65
182	300475	香农芯创	5,346,081.00	11.60
183	300612	宣亚国际	5,327,779.19	11.56
184	300045	华力创通	5,256,529.00	11.41
185	600425	青松建化	5,255,620.00	11.41
186	600009	上海机场	5,190,149.00	11.27

187	688521	芯原股份	5,160,532.51	11.20
188	601595	上海电影	5,153,483.00	11.19
189	002913	奥士康	5,064,477.00	10.99
190	688981	中芯国际	5,051,967.62	10.97
191	002373	千方科技	5,041,570.22	10.94
192	002436	兴森科技	5,026,022.00	10.91
193	002906	华阳集团	5,009,535.49	10.87
194	600030	中信证券	4,954,374.10	10.75
195	003031	中瓷电子	4,949,406.35	10.74
196	688195	腾景科技	4,914,617.86	10.67
197	600640	国脉文化	4,889,689.00	10.61
198	688418	震有科技	4,875,080.47	10.58
199	002465	海格通信	4,853,466.85	10.54
200	688252	天德钰	4,852,071.00	10.53
201	688152	麒麟信安	4,802,999.42	10.43
202	688039	当虹科技	4,789,422.38	10.40
203	002415	海康威视	4,769,873.00	10.35
204	002244	滨江集团	4,747,369.00	10.30
205	300351	永贵电器	4,700,746.00	10.20
206	688325	赛微微电	4,694,652.14	10.19
207	688037	芯源微	4,694,078.63	10.19
208	688409	富创精密	4,680,569.73	10.16
209	002803	吉宏股份	4,677,144.00	10.15
210	300454	深信服	4,668,220.00	10.13
211	301191	菲菱科思	4,664,111.00	10.12
212	300525	博思软件	4,628,799.00	10.05
213	002268	电科网安	4,613,520.75	10.01
214	688205	德科立	4,570,655.16	9.92
215	603138	海量数据	4,526,530.00	9.83
216	000681	视觉中国	4,511,617.00	9.79
217	000938	紫光股份	4,488,751.00	9.74



218	300571	平治信息	4,474,220.00	9.71
219	688533	上声电子	4,456,734.81	9.67
220	002371	北方华创	4,432,564.00	9.62
221	601857	中国石油	4,423,047.00	9.60
222	000596	古井贡酒	4,378,494.00	9.50
223	603985	恒润股份	4,314,132.00	9.36
224	300634	彩讯股份	4,298,206.00	9.33
225	301117	佳缘科技	4,249,439.00	9.22
226	603258	电魂网络	4,246,557.00	9.22
227	688387	信科移动	4,235,102.63	9.19
228	300465	高伟达	4,215,094.00	9.15
229	688369	致远互联	4,167,363.25	9.05
230	300803	指南针	4,163,944.00	9.04
231	603171	税友股份	4,157,883.00	9.03
232	688435	英方软件	4,144,616.57	9.00
233	688523	航天环宇	4,119,603.71	8.94
234	000002	万科A	4,118,843.13	8.94
235	300115	长盈精密	4,108,414.60	8.92
236	603118	共进股份	4,092,514.00	8.88
237	300182	捷成股份	4,060,624.00	8.81
238	002945	华林证券	4,056,129.00	8.80
239	002475	立讯精密	4,049,687.00	8.79
240	300499	高澜股份	4,032,287.00	8.75
241	002291	遥望科技	4,029,652.00	8.75
242	688568	中科星图	3,989,879.30	8.66
243	002929	润建股份	3,985,907.00	8.65
244	002624	完美世界	3,982,983.00	8.65
245	002174	游族网络	3,977,087.00	8.63
246	300570	太辰光	3,943,078.74	8.56
247	300342	天银机电	3,919,877.00	8.51
248	300280	紫天科技	3,903,078.00	8.47

249	002997	瑞鹄模具	3,887,870.75	8.44
250	688596	正帆科技	3,860,920.22	8.38
251	002036	联创电子	3,860,846.00	8.38
252	688061	灿瑞科技	3,817,632.69	8.29
253	002153	石基信息	3,797,590.20	8.24
254	002491	通鼎互联	3,701,158.00	8.03
255	301099	雅创电子	3,691,677.00	8.01
256	301171	易点天下	3,687,391.45	8.00
257	688213	思特威	3,677,989.06	7.98
258	601456	国联证券	3,649,362.00	7.92
259	688102	斯瑞新材	3,648,833.89	7.92
260	300679	电连技术	3,646,059.40	7.91
261	600109	国金证券	3,640,438.81	7.90
262	688200	华峰测控	3,636,867.78	7.89
263	300533	冰川网络	3,631,696.00	7.88
264	000539	粤电力A	3,625,406.00	7.87
265	688270	臻镭科技	3,623,209.00	7.86
266	002045	国光电器	3,599,958.00	7.81
267	688099	晶晨股份	3,573,924.03	7.76
268	300609	汇纳科技	3,563,761.00	7.74
269	300442	润泽科技	3,541,747.00	7.69
270	603306	华懋科技	3,538,366.00	7.68
271	688083	中望软件	3,522,303.28	7.65
272	600183	生益科技	3,514,750.10	7.63
273	600641	万业企业	3,482,457.00	7.56
274	300820	英杰电气	3,476,289.00	7.55
275	600986	浙文互联	3,439,643.00	7.47
276	300666	江丰电子	3,360,024.00	7.29
277	300479	神思电子	3,333,388.47	7.24
278	003021	兆威机电	3,331,818.00	7.23
279	688401	路维光电	3,316,681.36	7.20

280	301095	广立微	3,294,817.00	7.15
281	002405	四维图新	3,275,697.00	7.11
282	600498	烽火通信	3,247,417.00	7.05
283	600803	新奥股份	3,220,475.00	6.99
284	603348	文灿股份	3,201,089.59	6.95
285	301310	鑫宏业	3,194,668.00	6.93
286	603345	安井食品	3,159,952.20	6.86
287	300455	航天智装	3,156,539.60	6.85
288	601633	长城汽车	3,119,726.00	6.77
289	002292	奥飞娱乐	3,030,411.00	6.58
290	301052	果麦文化	3,013,327.00	6.54
291	688080	映翰通	3,007,526.18	6.53
292	601098	中南传媒	2,981,327.00	6.47
293	688060	云涌科技	2,978,532.37	6.47
294	000600	建投能源	2,973,342.00	6.45
295	688361	中科飞测	2,966,258.32	6.44
296	603232	格尔软件	2,963,255.94	6.43
297	000630	铜陵有色	2,945,778.00	6.39
298	600988	赤峰黄金	2,924,227.93	6.35
299	003012	东鹏控股	2,915,595.00	6.33
300	600095	湘财股份	2,914,563.00	6.33
301	300680	隆盛科技	2,903,593.27	6.30
302	601881	中国银河	2,903,217.00	6.30
303	688220	翱捷科技	2,899,175.71	6.29
304	688515	裕太微	2,882,133.47	6.26
305	300662	科锐国际	2,848,435.00	6.18
306	688019	安集科技	2,847,318.91	6.18
307	000503	国新健康	2,827,902.00	6.14
308	300291	百纳千成	2,824,154.00	6.13
309	688088	虹软科技	2,816,789.88	6.11
310	002241	歌尔股份	2,808,930.00	6.10

311	300913	兆龙互连	2,807,277.84	6.09
312	002993	奥海科技	2,798,034.00	6.07
313	600887	伊利股份	2,790,344.00	6.06
314	300299	富春股份	2,790,256.00	6.06
315	688082	盛美上海	2,773,414.71	6.02
316	688062	迈威生物	2,761,724.27	5.99
317	601669	中国电建	2,759,614.00	5.99
318	688391	钜泉科技	2,746,410.55	5.96
319	600845	宝信软件	2,742,385.00	5.95
320	603305	旭升集团	2,737,197.00	5.94
321	001270	铖昌科技	2,705,782.60	5.87
322	688419	耐科装备	2,691,308.04	5.84
323	600027	华电国际	2,687,922.00	5.83
324	688035	德邦科技	2,664,157.18	5.78
325	688776	国光电气	2,659,911.01	5.77
326	600578	京能电力	2,631,824.00	5.71
327	300357	我武生物	2,613,964.96	5.67
328	688209	英集芯	2,581,846.56	5.60
329	688167	炬光科技	2,574,106.59	5.59
330	688332	中科蓝讯	2,573,573.80	5.59
331	002304	洋河股份	2,520,993.00	5.47
332	300192	科德教育	2,505,721.00	5.44
333	600418	江淮汽车	2,498,862.00	5.42
334	002068	黑猫股份	2,489,098.12	5.40
335	000700	模塑科技	2,467,293.00	5.36
336	002876	三利谱	2,460,949.00	5.34
337	600373	中文传媒	2,439,219.00	5.29
338	300101	振芯科技	2,429,955.00	5.27
339	688601	力芯微	2,428,433.36	5.27
340	300353	东土科技	2,406,567.00	5.22
341	603737	三棵树	2,402,911.00	5.22

342	003032	传智教育	2,402,202.00	5.21
343	600028	中国石化	2,398,505.00	5.21
344	688004	博汇科技	2,384,421.08	5.18
345	600326	西藏天路	2,361,535.67	5.13
346	300346	南大光电	2,355,572.90	5.11
347	605133	嵘泰股份	2,348,487.00	5.10
348	301349	信德新材	2,340,755.00	5.08
349	002859	洁美科技	2,340,739.00	5.08
350	688326	经纬恒润	2,332,470.54	5.06
351	300426	唐德影视	2,324,159.00	5.04
352	688244	永信至诚	2,313,538.00	5.02
353	603218	日月股份	2,306,312.00	5.01
354	688318	财富趋势	2,301,486.93	5.00
355	002508	老板电器	2,300,581.00	4.99
356	688589	力合微	2,295,329.87	4.98
357	002602	世纪华通	2,285,403.00	4.96
358	603801	志邦家居	2,258,950.00	4.90
359	300781	因赛集团	2,258,898.30	4.90
360	688188	柏楚电子	2,248,734.46	4.88
361	603596	伯特利	2,247,894.00	4.88
362	688375	国博电子	2,245,759.91	4.87
363	688682	霍莱沃	2,241,845.66	4.87
364	601991	大唐发电	2,238,440.00	4.86
365	002797	第一创业	2,236,524.00	4.85
366	603927	中科软	2,229,836.00	4.84
367	688383	新益昌	2,226,746.79	4.83
368	000676	智度股份	2,215,313.72	4.81
369	000810	创维数字	2,212,902.00	4.80
370	002439	启明星辰	2,210,151.00	4.80
371	300909	汇创达	2,203,375.00	4.78
372	300043	星辉娱乐	2,195,875.00	4.77

373	002557	洽洽食品	2,193,878.07	4.76
374	600376	首开股份	2,192,944.00	4.76
375	601838	成都银行	2,183,339.00	4.74
376	688141	杰华特	2,170,514.65	4.71
377	603061	金海通	2,142,756.00	4.65
378	300181	佐力药业	2,130,778.00	4.63
379	300348	长亮科技	2,130,643.00	4.62
380	600153	建发股份	2,126,583.00	4.62
381	603108	润达医疗	2,119,246.00	4.60
382	601689	拓普集团	2,117,980.00	4.60
383	688376	美埃科技	2,105,547.61	4.57
384	600489	中金黄金	2,102,595.00	4.56
385	300911	亿田智能	2,092,669.00	4.54
386	688249	晶合集成	2,084,521.57	4.52
387	600702	舍得酒业	2,076,400.00	4.51
388	600919	江苏银行	2,069,228.00	4.49
389	600435	北方导航	2,056,934.00	4.46
390	600188	兖矿能源	2,054,119.50	4.46
391	300580	贝斯特	2,052,880.00	4.46
392	000661	长春高新	2,051,890.00	4.45
393	002935	天奥电子	2,037,942.50	4.42
394	002127	南极电商	2,030,592.00	4.41
395	600877	电科芯片	2,028,030.00	4.40
396	603096	新经典	2,018,278.00	4.38
397	002530	金财互联	2,010,633.00	4.36
398	601019	山东出版	2,009,614.33	4.36
399	002928	华夏航空	2,004,683.09	4.35
400	688052	纳芯微	2,001,002.68	4.34
401	688168	安博通	2,000,391.99	4.34
402	300275	梅安森	1,988,667.00	4.32
403	688053	思科瑞	1,977,786.73	4.29

404	301110	青木股份	1,968,886.00	4.27
405	688661	和林微纳	1,964,723.51	4.26
406	000960	锡业股份	1,950,125.00	4.23
407	000887	中鼎股份	1,948,303.00	4.23
408	603993	洛阳钼业	1,946,439.00	4.23
409	688629	华丰科技	1,941,513.33	4.21
410	688322	奥比中光	1,940,691.67	4.21
411	601128	常熟银行	1,940,619.00	4.21
412	000975	银泰黄金	1,935,497.00	4.20
413	688536	思瑞浦	1,932,038.54	4.19
414	600547	山东黄金	1,931,063.00	4.19
415	605368	蓝天燃气	1,911,497.40	4.15
416	688636	智明达	1,903,512.70	4.13
417	002962	五方光电	1,900,959.20	4.13
418	601658	邮储银行	1,899,714.00	4.12
419	300682	朗新科技	1,899,442.00	4.12
420	688192	迪哲医药	1,890,360.57	4.10
421	688777	中控技术	1,876,809.81	4.07
422	301208	中亦科技	1,867,325.00	4.05
423	603179	新泉股份	1,857,582.00	4.03
424	688036	传音控股	1,850,179.01	4.02
425	600171	上海贝岭	1,849,207.87	4.01
426	301013	利和兴	1,844,246.00	4.00
427	002965	祥鑫科技	1,830,463.00	3.97
428	002142	宁波银行	1,806,265.00	3.92
429	300674	宇信科技	1,791,727.00	3.89
430	600926	杭州银行	1,789,432.00	3.88
431	688227	品高股份	1,786,342.91	3.88
432	601699	潞安环能	1,735,936.70	3.77
433	300896	爱美客	1,714,942.00	3.72
434	601698	中国卫通	1,708,825.00	3.71

435	002712	思美传媒	1,700,418.00	3.69
436	300241	瑞丰光电	1,696,638.00	3.68
437	300034	钢研高纳	1,691,600.40	3.67
438	600036	招商银行	1,685,065.00	3.66
439	688127	蓝特光学	1,677,046.93	3.64
440	301330	熵基科技	1,670,302.00	3.63
441	600754	锦江酒店	1,666,003.02	3.62
442	688229	博睿数据	1,665,456.85	3.62
443	002649	博彦科技	1,648,291.00	3.58
444	603612	索通发展	1,645,974.00	3.57
445	688147	微导纳米	1,643,842.40	3.57
446	688239	航宇科技	1,627,106.24	3.53
447	000690	宝新能源	1,624,428.86	3.53
448	603768	常青股份	1,624,114.00	3.53
449	600100	同方股份	1,621,990.00	3.52
450	688234	天岳先进	1,602,687.92	3.48
451	688018	乐鑫科技	1,597,745.45	3.47
452	688630	芯碁微装	1,594,791.23	3.46
453	002152	广电运通	1,585,691.00	3.44
454	600587	新华医疗	1,585,182.00	3.44
455	601900	南方传媒	1,582,483.00	3.43
456	300332	天壕能源	1,580,784.00	3.43
457	601108	财通证券	1,568,112.00	3.40
458	688107	安路科技	1,562,309.86	3.39
459	688023	安恒信息	1,558,234.03	3.38
460	600399	抚顺特钢	1,549,974.00	3.36
461	300015	爱尔眼科	1,547,801.52	3.36
462	603629	利通电子	1,543,657.00	3.35
463	300908	仲景食品	1,539,065.00	3.34
464	600546	山煤国际	1,536,278.00	3.33
465	600795	国电电力	1,530,876.00	3.32



466	300260	新莱应材	1,530,480.00	3.32
467	600150	中国船舶	1,530,350.00	3.32
468	603039	泛微网络	1,518,201.00	3.30
469	600206	有研新材	1,514,470.96	3.29
470	300866	安克创新	1,514,089.00	3.29
471	688271	联影医疗	1,513,251.02	3.28
472	300747	锐科激光	1,508,835.00	3.28
473	300638	广和通	1,501,210.00	3.26
474	300602	飞荣达	1,498,708.00	3.25
475	301239	普瑞眼科	1,490,749.00	3.24
476	688071	华依科技	1,474,908.44	3.20
477	603236	移远通信	1,473,150.00	3.20
478	300085	银之杰	1,472,543.00	3.20
479	002916	深南电路	1,472,139.00	3.20
480	688385	复旦微电	1,465,388.46	3.18
481	688697	纽威数控	1,441,581.58	3.13
482	688366	昊海生科	1,439,092.55	3.12
483	300769	德方纳米	1,433,007.00	3.11
484	300825	阿尔特	1,431,836.00	3.11
485	688508	芯朋微	1,431,227.70	3.11
486	002126	银轮股份	1,428,612.00	3.10
487	603806	福斯特	1,422,118.00	3.09
488	688390	固德威	1,411,284.09	3.06
489	603662	柯力传感	1,405,640.00	3.05
490	002955	鸿合科技	1,393,994.00	3.03
491	002422	科伦药业	1,392,997.00	3.02
492	600570	恒生电子	1,386,785.00	3.01
493	300969	恒帅股份	1,384,428.00	3.01
494	300520	科大国创	1,373,798.00	2.98
495	002384	东山精密	1,356,075.00	2.94
496	688027	国盾量子	1,349,849.06	2.93

497	000860	顺鑫农业	1,337,438.00	2.90
498	300763	锦浪科技	1,320,454.00	2.87
499	688172	燕东微	1,307,479.35	2.84
500	688618	三旺通信	1,299,613.02	2.82
501	600699	均胜电子	1,285,550.00	2.79
502	300628	亿联网络	1,285,536.00	2.79
503	300785	值得买	1,275,677.00	2.77
504	600309	万华化学	1,275,526.00	2.77
505	300166	东方国信	1,251,041.00	2.72
506	300613	富瀚微	1,249,328.71	2.71
507	603690	至纯科技	1,242,155.00	2.70
508	300408	三环集团	1,237,112.00	2.69
509	002648	卫星化学	1,210,229.00	2.63
510	688403	汇成股份	1,202,406.50	2.61
511	301299	卓创资讯	1,201,522.00	2.61
512	603296	华勤技术	1,200,764.00	2.61
513	000063	中兴通讯	1,199,542.00	2.60
514	300655	晶瑞电材	1,190,357.00	2.58
515	300403	汉宇集团	1,182,582.00	2.57
516	000932	华菱钢铁	1,181,241.00	2.56
517	000603	盛达资源	1,170,566.00	2.54
518	688030	山石网科	1,170,452.92	2.54
519	688025	杰普特	1,167,277.35	2.53
520	002792	通宇通讯	1,165,931.00	2.53
521	688002	睿创微纳	1,154,298.46	2.51
522	002229	鸿博股份	1,152,193.00	2.50
523	600686	金龙汽车	1,151,378.00	2.50
524	300274	阳光电源	1,150,514.00	2.50
525	688305	科德数控	1,134,000.00	2.46
526	300737	科顺股份	1,133,298.00	2.46
527	300578	会畅通讯	1,121,277.00	2.43

528	600114	东睦股份	1,115,002.00	2.42
529	600266	城建发展	1,109,948.00	2.41
530	688516	奥特维	1,106,824.76	2.40
531	688259	创耀科技	1,106,552.70	2.40
532	300379	东方通	1,090,558.00	2.37
533	300344	立方数科	1,089,629.00	2.37
534	688711	宏微科技	1,086,903.13	2.36
535	002043	兔宝宝	1,079,984.00	2.34
536	688262	国芯科技	1,074,614.68	2.33
537	688368	晶丰明源	1,074,524.43	2.33
538	688337	普源精电	1,067,048.44	2.32
539	301080	百普赛斯	1,063,413.00	2.31
540	688226	威腾电气	1,051,726.55	2.28
541	300757	罗博特科	1,048,257.00	2.28
542	688550	瑞联新材	1,045,628.62	2.27
543	688458	美芯晟	1,037,285.85	2.25
544	603583	捷昌驱动	1,037,047.00	2.25
545	688486	龙迅股份	1,029,649.62	2.23
546	601001	晋控煤业	1,024,720.00	2.22
547	601233	桐昆股份	1,024,328.00	2.22
548	600258	首旅酒店	1,017,284.00	2.21
549	002990	盛视科技	1,015,056.00	2.20
550	001308	康冠科技	996,510.20	2.16
551	688225	亚信安全	994,305.43	2.16
552	300559	佳发教育	991,523.00	2.15
553	688059	华锐精密	985,263.01	2.14
554	002532	天山铝业	975,953.00	2.12
555	002657	中科金财	972,337.00	2.11
556	688373	盟科药业	968,698.51	2.10
557	300451	创业慧康	966,761.00	2.10
558	688676	金盘科技	964,944.28	2.09

559	002608	江苏国信	964,698.00	2.09
560	000983	山西焦煤	964,441.00	2.09
561	002583	海能达	952,662.00	2.07
562	002600	领益智造	951,543.00	2.07
563	002051	中工国际	930,361.00	2.02
564	000333	美的集团	926,769.00	2.01
565	002138	顺络电子	924,882.00	2.01

注：表中“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	600536	中国软件	32,757,186.21	71.10
2	002368	太极股份	28,579,549.12	62.04
3	300624	万兴科技	27,319,730.70	59.30
4	000032	深桑达A	26,956,714.94	58.51
5	300212	易华录	26,106,026.95	56.67
6	688031	星环科技	24,465,125.42	53.10
7	002230	科大讯飞	22,170,570.42	48.12
8	688256	寒武纪	21,785,369.11	47.29
9	600602	云赛智联	21,597,989.14	46.88
10	300418	昆仑万维	20,557,763.46	44.62
11	300226	上海钢联	20,448,182.44	44.39
12	002912	中新赛克	19,715,984.21	42.80
13	300058	蓝色光标	19,212,723.61	41.70
14	300033	同花顺	19,128,680.82	41.52
15	688111	金山办公	19,055,429.33	41.36
16	600941	中国移动	18,847,631.00	40.91

17	300496	中科创达	17,904,995.00	38.87
18	300366	创意信息	17,847,898.31	38.74
19	601728	中国电信	17,845,018.01	38.74
20	000977	浪潮信息	17,419,978.00	37.81
21	002777	久远银海	17,132,946.63	37.19
22	300308	中际旭创	16,609,905.50	36.05
23	300188	美亚柏科	16,413,739.40	35.63
24	300394	天孚通信	16,087,663.20	34.92
25	000034	神州数码	16,069,896.97	34.88
26	601138	工业富联	15,590,420.51	33.84
27	688012	中微公司	15,562,936.12	33.78
28	003029	吉大正元	15,463,898.80	33.57
29	688095	福昕软件	15,017,978.43	32.60
30	603019	中科曙光	14,269,822.30	30.97
31	002908	德生科技	13,812,491.96	29.98
32	000021	深科技	13,654,539.00	29.64
33	601360	三六零	13,619,592.21	29.56
34	300364	中文在线	13,514,979.00	29.34
35	688579	山大地纬	13,296,611.73	28.86
36	688787	海天瑞声	13,057,802.73	28.34
37	300002	神州泰岳	12,947,701.00	28.10
38	601390	中国中铁	12,811,688.38	27.81
39	300459	汤姆猫	12,772,442.73	27.72
40	600050	中国联通	12,748,269.00	27.67
41	002351	漫步者	12,700,419.43	27.57
42	600839	四川长虹	12,485,500.13	27.10
43	688041	海光信息	12,420,944.18	26.96
44	601601	中国太保	12,121,180.00	26.31
45	000066	中国长城	11,788,934.00	25.59
46	601628	中国人寿	11,675,281.00	25.34
47	600584	长电科技	11,520,372.00	25.01

48	601318	中国平安	11,461,407.30	24.88
49	603000	人民网	11,406,703.65	24.76
50	300229	拓尔思	11,394,487.82	24.73
51	002156	通富微电	11,304,182.00	24.54
52	300604	长川科技	11,259,146.30	24.44
53	603496	恒为科技	11,251,837.58	24.42
54	601111	中国国航	11,070,345.00	24.03
55	300687	赛意信息	10,946,239.00	23.76
56	002409	雅克科技	10,932,504.80	23.73
57	688110	东芯股份	10,866,633.74	23.59
58	300031	宝通科技	10,848,580.00	23.55
59	688498	源杰科技	10,709,938.26	23.25
60	300659	中孚信息	10,702,311.20	23.23
61	688066	航天宏图	10,674,750.62	23.17
62	688362	甬矽电子	10,645,315.52	23.11
63	605168	三人行	10,536,369.40	22.87
64	000933	神火股份	10,534,154.00	22.87
65	688327	云从科技	10,383,675.06	22.54
66	688201	信安世纪	10,346,154.49	22.46
67	601800	中国交建	10,337,559.00	22.44
68	301236	软通动力	10,327,758.85	22.42
69	300474	景嘉微	10,244,351.73	22.24
70	601186	中国铁建	10,134,094.00	22.00
71	002236	大华股份	9,969,779.00	21.64
72	688365	光云科技	9,860,845.49	21.40
73	601899	紫金矿业	9,562,684.00	20.76
74	000928	中钢国际	9,511,796.00	20.65
75	601021	春秋航空	9,388,232.00	20.38
76	600519	贵州茅台	9,383,705.00	20.37
77	301269	华大九天	9,355,472.00	20.31
78	300502	新易盛	9,336,536.80	20.27

79	300996	普联软件	9,273,314.00	20.13
80	603888	新华网	9,094,094.00	19.74
81	002123	梦网科技	8,865,419.00	19.24
82	688008	澜起科技	8,774,964.97	19.05
83	688766	普冉股份	8,770,572.77	19.04
84	002605	姚记科技	8,762,687.00	19.02
85	002315	焦点科技	8,571,317.00	18.61
86	600011	华能国际	8,550,784.00	18.56
87	300130	新国都	8,535,571.88	18.53
88	601995	中金公司	8,529,375.00	18.51
89	300476	胜宏科技	8,429,680.00	18.30
90	301153	中科江南	8,427,350.00	18.29
91	688246	嘉和美康	8,370,310.71	18.17
92	688120	华海清科	8,367,485.23	18.16
93	600850	电科数字	8,282,597.00	17.98
94	002261	拓维信息	8,262,383.15	17.93
95	688372	伟测科技	8,260,125.36	17.93
96	002941	新疆交建	8,066,432.40	17.51
97	600633	浙数文化	7,974,142.48	17.31
98	002555	三七互娱	7,924,169.00	17.20
99	300548	博创科技	7,876,720.24	17.10
100	000543	皖能电力	7,872,606.00	17.09
101	603444	吉比特	7,858,267.00	17.06
102	600642	申能股份	7,781,354.00	16.89
103	001309	德明利	7,776,690.20	16.88
104	600958	东方证券	7,729,264.08	16.78
105	300170	汉得信息	7,723,198.00	16.76
106	300251	光线传媒	7,641,845.94	16.59
107	000988	华工科技	7,640,661.00	16.59
108	301308	江波龙	7,614,350.03	16.53
109	603885	吉祥航空	7,597,470.00	16.49

110	002063	远光软件	7,517,027.77	16.32
111	601336	新华保险	7,479,179.34	16.23
112	301169	零点有数	7,468,012.00	16.21
113	002517	恺英网络	7,406,931.00	16.08
114	600048	保利发展	7,371,014.00	16.00
115	600809	山西汾酒	7,340,134.00	15.93
116	600029	南方航空	7,309,067.97	15.87
117	603383	顶点软件	7,281,464.00	15.81
118	300054	鼎龙股份	7,236,542.43	15.71
119	001311	多利科技	7,222,188.00	15.68
120	603501	韦尔股份	7,214,151.00	15.66
121	002987	京北方	7,094,198.00	15.40
122	002544	普天科技	7,082,817.00	15.37
123	600977	中国电影	7,025,634.00	15.25
124	688072	拓荆科技	6,964,119.06	15.12
125	000568	泸州老窖	6,929,195.00	15.04
126	002531	天顺风能	6,894,760.00	14.97
127	601117	中国化学	6,869,479.00	14.91
128	300136	信维通信	6,857,496.00	14.89
129	300766	每日互动	6,805,816.00	14.77
130	300494	盛天网络	6,796,620.00	14.75
131	300443	金雷股份	6,782,954.85	14.72
132	002487	大金重工	6,749,500.00	14.65
133	300567	精测电子	6,666,374.00	14.47
134	601600	中国铝业	6,659,499.00	14.46
135	603918	金桥信息	6,649,122.57	14.43
136	002463	沪电股份	6,626,318.00	14.38
137	688047	龙芯中科	6,622,834.15	14.38
138	002446	盛路通信	6,568,425.08	14.26
139	600023	浙能电力	6,538,927.00	14.19
140	600970	中材国际	6,471,355.60	14.05



141	603986	兆易创新	6,442,418.00	13.98
142	300315	掌趣科技	6,367,394.55	13.82
143	688153	唯捷创芯	6,273,456.13	13.62
144	688001	华兴源创	6,261,932.12	13.59
145	688258	卓易信息	6,260,234.65	13.59
146	000807	云铝股份	6,145,462.00	13.34
147	002558	巨人网络	6,134,493.00	13.32
148	603005	晶方科技	6,096,985.40	13.23
149	000065	北方国际	6,092,033.00	13.22
150	300592	华凯易佰	6,086,984.99	13.21
151	300762	上海瀚讯	6,071,325.00	13.18
152	300129	泰胜风能	6,049,389.00	13.13
153	001979	招商蛇口	5,998,817.00	13.02
154	600667	太极实业	5,984,316.00	12.99
155	600383	金地集团	5,942,727.00	12.90
156	301155	海力风电	5,938,342.00	12.89
157	300750	宁德时代	5,894,422.00	12.79
158	300250	初灵信息	5,885,610.26	12.78
159	000776	广发证券	5,872,722.60	12.75
160	688123	聚辰股份	5,859,066.54	12.72
161	002609	捷顺科技	5,853,187.00	12.71
162	601595	上海电影	5,847,243.00	12.69
163	300133	华策影视	5,791,505.00	12.57
164	300525	博思软件	5,781,765.00	12.55
165	605222	起帆电缆	5,746,600.00	12.47
166	688798	艾为电子	5,739,436.53	12.46
167	601377	兴业证券	5,714,534.40	12.40
168	605289	罗曼股份	5,688,159.00	12.35
169	300475	香农芯创	5,666,638.04	12.30
170	300570	太辰光	5,626,542.84	12.21
171	002268	电科网安	5,603,146.02	12.16

172	600325	华发股份	5,597,441.93	12.15
173	000858	五粮液	5,567,574.00	12.09
174	300738	奥飞数据	5,559,542.00	12.07
175	601668	中国建筑	5,558,622.00	12.07
176	603636	南威软件	5,521,321.50	11.98
177	603606	东方电缆	5,515,510.00	11.97
178	300458	全志科技	5,498,576.50	11.94
179	300075	数字政通	5,415,336.20	11.75
180	688608	恒玄科技	5,392,533.60	11.71
181	600105	永鼎股份	5,392,146.60	11.70
182	600115	中国东航	5,378,246.00	11.67
183	300223	北京君正	5,300,802.00	11.51
184	003031	中瓷电子	5,299,541.20	11.50
185	688252	天德钰	5,220,379.91	11.33
186	688981	中芯国际	5,187,801.64	11.26
187	300036	超图软件	5,175,992.00	11.24
188	002436	兴森科技	5,149,487.06	11.18
189	300342	天银机电	5,147,057.59	11.17
190	600009	上海机场	5,142,263.00	11.16
191	002906	华阳集团	5,133,278.00	11.14
192	002599	盛通股份	5,119,135.00	11.11
193	688195	腾景科技	5,117,671.81	11.11
194	688205	德科立	5,097,973.00	11.07
195	600425	青松建化	5,042,163.00	10.94
196	600640	国脉文化	4,969,279.00	10.79
197	688418	震有科技	4,969,098.28	10.79
198	600030	中信证券	4,915,089.00	10.67
199	002803	吉宏股份	4,912,653.00	10.66
200	002153	石基信息	4,908,852.90	10.66
201	688152	麒麟信安	4,880,967.91	10.59
202	688521	芯原股份	4,879,152.55	10.59

203	603650	彤程新材	4,843,173.19	10.51
204	300045	华力创通	4,813,002.00	10.45
205	002913	奥士康	4,795,909.00	10.41
206	002465	海格通信	4,779,170.41	10.37
207	002373	千方科技	4,759,425.70	10.33
208	002244	滨江集团	4,755,486.00	10.32
209	300612	宣亚国际	4,734,035.00	10.28
210	688039	当虹科技	4,705,971.72	10.21
211	301191	菲菱科思	4,692,587.00	10.19
212	300454	深信服	4,654,320.00	10.10
213	688325	赛微微电	4,639,753.40	10.07
214	688409	富创精密	4,634,310.67	10.06
215	000938	紫光股份	4,570,522.89	9.92
216	603138	海量数据	4,528,865.00	9.83
217	688037	芯源微	4,516,064.85	9.80
218	601857	中国石油	4,512,913.99	9.80
219	300465	高伟达	4,502,280.00	9.77
220	002415	海康威视	4,461,556.00	9.68
221	688533	上声电子	4,420,399.44	9.60
222	000681	视觉中国	4,412,634.00	9.58
223	000596	古井贡酒	4,411,200.00	9.58
224	301117	佳缘科技	4,391,667.00	9.53
225	603985	恒润股份	4,367,701.00	9.48
226	301171	易点天下	4,325,591.00	9.39
227	002371	北方华创	4,287,186.00	9.31
228	002036	联创电子	4,259,719.48	9.25
229	688387	信科移动	4,178,411.48	9.07
230	000002	万科A	4,157,901.00	9.03
231	300442	润泽科技	4,132,365.00	8.97
232	300634	彩讯股份	4,128,599.00	8.96
233	603171	税友股份	4,113,555.00	8.93

234	688435	英方软件	4,089,154.55	8.88
235	300351	永贵电器	4,068,520.00	8.83
236	688523	航天环宇	4,060,692.34	8.81
237	688568	中科星图	4,057,788.05	8.81
238	300115	长盈精密	4,051,498.29	8.79
239	603258	电魂网络	4,031,795.00	8.75
240	300571	平治信息	4,026,296.00	8.74
241	002929	润建股份	4,016,085.00	8.72
242	300803	指南针	3,991,695.00	8.66
243	603118	共进股份	3,952,887.00	8.58
244	002997	瑞鹤模具	3,945,229.94	8.56
245	688369	致远互联	3,944,984.93	8.56
246	002945	华林证券	3,940,194.00	8.55
247	300499	高澜股份	3,914,647.00	8.50
248	002475	立讯精密	3,889,722.00	8.44
249	300280	紫天科技	3,887,552.00	8.44
250	603232	格尔软件	3,842,822.80	8.34
251	300182	捷成股份	3,783,836.97	8.21
252	688083	中望软件	3,709,512.34	8.05
253	688270	臻镭科技	3,706,862.58	8.05
254	688213	思特威	3,682,464.45	7.99
255	300533	冰川网络	3,681,202.00	7.99
256	688060	云涌科技	3,666,880.71	7.96
257	688102	斯瑞新材	3,665,778.86	7.96
258	002292	奥飞娱乐	3,649,351.00	7.92
259	002174	游族网络	3,635,217.00	7.89
260	000539	粤电力A	3,620,448.00	7.86
261	600109	国金证券	3,614,681.00	7.85
262	300679	电连技术	3,613,768.00	7.84
263	002291	遥望科技	3,613,072.00	7.84
264	688061	灿瑞科技	3,601,234.92	7.82

265	603306	华懋科技	3,591,037.00	7.79
266	688596	正帆科技	3,579,054.50	7.77
267	301099	雅创电子	3,577,077.00	7.76
268	601456	国联证券	3,558,143.00	7.72
269	002624	完美世界	3,533,885.00	7.67
270	002491	通鼎互联	3,494,218.00	7.58
271	300479	神思电子	3,486,388.70	7.57
272	688200	华峰测控	3,476,765.17	7.55
273	300820	英杰电气	3,471,412.42	7.54
274	688099	晶晨股份	3,470,456.78	7.53
275	003021	兆威机电	3,451,745.00	7.49
276	600183	生益科技	3,413,556.00	7.41
277	002045	国光电器	3,399,847.00	7.38
278	002439	启明星辰	3,348,154.00	7.27
279	600498	烽火通信	3,340,013.00	7.25
280	603348	文灿股份	3,316,180.69	7.20
281	600641	万业企业	3,315,977.96	7.20
282	301095	广立微	3,272,718.88	7.10
283	300666	江丰电子	3,248,582.00	7.05
284	300455	航天智装	3,231,343.00	7.01
285	300609	汇纳科技	3,188,600.00	6.92
286	601633	长城汽车	3,117,906.00	6.77
287	600803	新奥股份	3,104,837.00	6.74
288	603345	安井食品	3,075,750.00	6.68
289	688401	路维光电	3,052,718.40	6.63
290	000600	建投能源	3,051,506.00	6.62
291	600986	浙文互联	3,023,260.00	6.56
292	688682	霍莱沃	3,022,078.35	6.56
293	600845	宝信软件	3,019,279.18	6.55
294	688080	映翰通	3,014,382.23	6.54
295	301310	鑫宏业	2,954,918.00	6.41

296	601881	中国银河	2,947,386.00	6.40
297	688361	中科飞测	2,932,677.20	6.37
298	600988	赤峰黄金	2,907,056.00	6.31
299	000630	铜陵有色	2,903,274.00	6.30
300	002241	歌尔股份	2,891,881.00	6.28
301	002993	奥海科技	2,888,407.00	6.27
302	600887	伊利股份	2,869,020.00	6.23
303	688062	迈威生物	2,868,031.02	6.23
304	601669	中国电建	2,858,318.00	6.20
305	300913	兆龙互连	2,850,750.00	6.19
306	003012	东鹏控股	2,844,877.00	6.18
307	600095	湘财股份	2,835,471.00	6.15
308	688019	安集科技	2,825,559.90	6.13
309	688220	翱捷科技	2,819,008.00	6.12
310	001270	铖昌科技	2,809,456.00	6.10
311	300680	隆盛科技	2,809,086.00	6.10
312	600027	华电国际	2,804,670.00	6.09
313	300662	科锐国际	2,793,978.00	6.06
314	301052	果麦文化	2,780,998.00	6.04
315	300291	百纳千成	2,764,060.00	6.00
316	300426	唐德影视	2,752,209.74	5.97
317	000503	国新健康	2,745,764.00	5.96
318	300299	富春股份	2,735,845.00	5.94
319	688088	虹软科技	2,734,413.95	5.94
320	688391	钜泉科技	2,714,338.04	5.89
321	601098	中南传媒	2,701,491.00	5.86
322	688082	盛美上海	2,698,532.58	5.86
323	002530	金财互联	2,695,883.00	5.85
324	688023	安恒信息	2,659,107.00	5.77
325	600578	京能电力	2,650,192.00	5.75
326	002876	三利谱	2,643,155.00	5.74

327	002405	四维图新	2,608,291.00	5.66
328	002152	广电运通	2,607,893.00	5.66
329	688776	国光电气	2,598,282.36	5.64
330	300357	我武生物	2,582,885.08	5.61
331	688515	裕太微	2,580,058.54	5.60
332	688209	英集芯	2,569,126.90	5.58
333	000700	模塑科技	2,525,615.00	5.48
334	603305	旭升集团	2,500,283.00	5.43
335	688167	炬光科技	2,477,149.67	5.38
336	002304	洋河股份	2,470,924.00	5.36
337	688332	中科蓝讯	2,452,586.05	5.32
338	600028	中国石化	2,427,178.00	5.27
339	688188	柏楚电子	2,370,785.68	5.15
340	300101	振芯科技	2,365,942.95	5.14
341	688419	耐科装备	2,359,619.09	5.12
342	688244	永信至诚	2,345,857.57	5.09
343	603737	三棵树	2,341,992.00	5.08
344	300353	东土科技	2,335,810.00	5.07
345	002859	洁美科技	2,334,924.00	5.07
346	002068	黑猫股份	2,326,729.00	5.05
347	688589	力合微	2,310,720.44	5.02
348	600418	江淮汽车	2,310,713.00	5.02
349	002797	第一创业	2,310,465.00	5.02
350	603927	中科软	2,302,423.00	5.00
351	300192	科德教育	2,295,020.00	4.98
352	688004	博汇科技	2,293,458.68	4.98
353	605133	嵘泰股份	2,266,444.00	4.92
354	300346	南大光电	2,261,784.50	4.91
355	603596	伯特利	2,257,483.00	4.90
356	600326	西藏天路	2,256,913.80	4.90
357	300275	梅安森	2,253,773.00	4.89

358	688052	纳芯微	2,250,547.52	4.89
359	002602	世纪华通	2,240,574.24	4.86
360	688192	迪哲医药	2,239,811.05	4.86
361	603218	日月股份	2,238,445.00	4.86
362	688601	力芯微	2,230,208.60	4.84
363	688318	财富趋势	2,217,993.19	4.81
364	601991	大唐发电	2,216,712.00	4.81
365	688326	经纬恒润	2,211,532.88	4.80
366	002508	老板电器	2,208,714.00	4.79
367	688375	国博电子	2,202,932.19	4.78
368	688035	德邦科技	2,201,343.53	4.78
369	603801	志邦家居	2,197,388.00	4.77
370	301299	卓创资讯	2,189,081.00	4.75
371	600188	兖矿能源	2,161,933.27	4.69
372	688376	美埃科技	2,159,993.35	4.69
373	002557	洽洽食品	2,159,486.00	4.69
374	000676	智度股份	2,154,750.00	4.68
375	002990	盛视科技	2,153,959.00	4.68
376	603061	金海通	2,151,786.00	4.67
377	600153	建发股份	2,149,340.00	4.67
378	600376	首开股份	2,146,612.00	4.66
379	600373	中文传媒	2,140,078.48	4.65
380	301110	青木股份	2,131,961.00	4.63
381	003032	传智教育	2,130,973.00	4.63
382	000810	创维数字	2,126,564.00	4.62
383	300781	因赛集团	2,122,079.00	4.61
384	300043	星辉娱乐	2,116,268.00	4.59
385	300580	贝斯特	2,107,259.00	4.57
386	300911	亿田智能	2,102,928.00	4.56
387	688141	杰华特	2,092,824.17	4.54
388	688383	新益昌	2,092,473.97	4.54



389	601838	成都银行	2,070,047.00	4.49
390	002935	天奥电子	2,063,376.00	4.48
391	600919	江苏银行	2,053,772.00	4.46
392	300909	汇创达	2,024,779.00	4.40
393	688536	思瑞浦	2,022,718.02	4.39
394	002127	南极电商	2,022,182.00	4.39
395	300181	佐力药业	2,019,592.00	4.38
396	603108	润达医疗	2,018,906.00	4.38
397	600435	北方导航	2,014,537.00	4.37
398	000661	长春高新	2,010,196.60	4.36
399	601689	拓普集团	2,009,586.30	4.36
400	688168	安博通	2,009,458.02	4.36
401	603993	洛阳钼业	2,003,928.00	4.35
402	600702	舍得酒业	1,997,154.00	4.34
403	600489	中金黄金	1,994,811.00	4.33
404	000887	中鼎股份	1,990,125.00	4.32
405	600877	电科芯片	1,989,557.00	4.32
406	688322	奥比中光	1,975,540.35	4.29
407	688249	晶合集成	1,969,356.00	4.27
408	601128	常熟银行	1,963,632.00	4.26
409	002962	五方光电	1,962,448.01	4.26
410	688777	中控技术	1,945,460.24	4.22
411	688629	华丰科技	1,937,838.42	4.21
412	300348	长亮科技	1,929,278.52	4.19
413	002928	华夏航空	1,904,416.00	4.13
414	605368	蓝天燃气	1,897,609.60	4.12
415	000975	银泰黄金	1,886,645.00	4.10
416	002142	宁波银行	1,885,634.40	4.09
417	601658	邮储银行	1,878,843.00	4.08
418	301208	中亦科技	1,871,279.00	4.06
419	000960	锡业股份	1,868,831.00	4.06

420	603096	新经典	1,860,546.50	4.04
421	300682	朗新科技	1,855,840.00	4.03
422	301013	利和兴	1,852,826.00	4.02
423	600547	山东黄金	1,846,151.00	4.01
424	600171	上海贝岭	1,841,446.00	4.00
425	002965	祥鑫科技	1,838,202.00	3.99
426	688053	思科瑞	1,836,809.52	3.99
427	300674	宇信科技	1,836,221.00	3.99
428	688661	和林微纳	1,825,995.16	3.96
429	601699	潞安环能	1,823,348.00	3.96
430	600926	杭州银行	1,777,072.00	3.86
431	603179	新泉股份	1,776,581.00	3.86
432	688636	智明达	1,772,557.43	3.85
433	600036	招商银行	1,763,909.00	3.83
434	301330	熵基科技	1,745,544.25	3.79
435	301349	信德新材	1,727,090.00	3.75
436	688036	传音控股	1,725,843.98	3.75
437	300451	创业慧康	1,711,642.00	3.72
438	688227	品高股份	1,710,773.57	3.71
439	600754	锦江酒店	1,682,572.90	3.65
440	601019	山东出版	1,678,913.16	3.64
441	300896	爱美客	1,675,079.00	3.64
442	000690	宝新能源	1,672,860.00	3.63
443	601698	中国卫通	1,669,346.02	3.62
444	688127	蓝特光学	1,667,304.29	3.62
445	300034	钢研高纳	1,656,849.00	3.60
446	300241	瑞丰光电	1,653,724.00	3.59
447	603768	常青股份	1,648,786.00	3.58
448	601900	南方传媒	1,646,573.00	3.57
449	002649	博彦科技	1,637,745.00	3.55
450	603612	索通发展	1,608,993.00	3.49

451	688239	航宇科技	1,589,418.66	3.45
452	600587	新华医疗	1,576,116.00	3.42
453	600100	同方股份	1,562,046.00	3.39
454	601108	财通证券	1,557,851.00	3.38
455	688147	微导纳米	1,540,705.01	3.34
456	688107	安路科技	1,539,545.89	3.34
457	300908	仲景食品	1,538,941.00	3.34
458	600546	山煤国际	1,534,617.00	3.33
459	300332	天壕能源	1,530,687.00	3.32
460	603629	利通电子	1,527,199.00	3.31
461	300015	爱尔眼科	1,525,106.00	3.31
462	600795	国电电力	1,523,944.00	3.31
463	600150	中国船舶	1,520,000.00	3.30
464	600399	抚顺特钢	1,516,475.00	3.29
465	301239	普瑞眼科	1,510,516.00	3.28
466	688229	博睿数据	1,509,919.62	3.28
467	300747	锐科激光	1,501,203.00	3.26
468	688271	联影医疗	1,498,802.88	3.25
469	002126	银轮股份	1,489,187.00	3.23
470	300602	飞荣达	1,481,411.00	3.22
471	688071	华依科技	1,480,835.09	3.21
472	300260	新莱应材	1,477,088.00	3.21
473	688697	纽威数控	1,476,802.71	3.21
474	300866	安克创新	1,475,419.00	3.20
475	600206	有研新材	1,473,041.00	3.20
476	688508	芯朋微	1,472,640.88	3.20
477	688630	芯碁微装	1,471,299.80	3.19
478	688385	复旦微电	1,462,910.28	3.18
479	688366	昊海生科	1,462,656.00	3.17
480	300638	广和通	1,450,977.00	3.15
481	688018	乐鑫科技	1,450,361.71	3.15

482	688234	天岳先进	1,440,839.58	3.13
483	603236	移远通信	1,436,967.20	3.12
484	002712	思美传媒	1,429,756.00	3.10
485	603039	泛微网络	1,429,360.00	3.10
486	300520	科大国创	1,426,007.00	3.10
487	300085	银之杰	1,395,011.00	3.03
488	002916	深南电路	1,375,743.00	2.99
489	603662	柯力传感	1,365,476.00	2.96
490	002422	科伦药业	1,355,921.00	2.94
491	603806	福斯特	1,355,280.00	2.94
492	002955	鸿合科技	1,351,091.00	2.93
493	688390	固德威	1,351,003.00	2.93
494	000860	顺鑫农业	1,347,522.00	2.92
495	688027	国盾量子	1,335,396.16	2.90
496	688172	燕东微	1,334,954.34	2.90
497	300769	德方纳米	1,326,669.60	2.88
498	300969	恒帅股份	1,322,066.00	2.87
499	002792	通宇通讯	1,304,348.00	2.83
500	603296	华勤技术	1,295,354.00	2.81
501	600570	恒生电子	1,275,307.10	2.77
502	300408	三环集团	1,261,275.00	2.74
503	300825	阿尔特	1,259,690.00	2.73
504	688403	汇成股份	1,257,165.31	2.73
505	300628	亿联网络	1,250,438.00	2.71
506	688025	杰普特	1,250,257.70	2.71
507	600309	万华化学	1,249,455.00	2.71
508	688618	三旺通信	1,240,975.66	2.69
509	300763	锦浪科技	1,240,017.00	2.69
510	688002	睿创微纳	1,237,922.40	2.69
511	688305	科德数控	1,217,015.01	2.64
512	300166	东方国信	1,210,382.00	2.63

513	000063	中兴通讯	1,209,490.00	2.63
514	002648	卫星化学	1,201,725.00	2.61
515	002384	东山精密	1,200,339.00	2.61
516	688030	山石网科	1,184,770.30	2.57
517	300613	富瀚微	1,182,885.00	2.57
518	600686	金龙汽车	1,181,699.00	2.57
519	688262	国芯科技	1,177,046.33	2.55
520	600699	均胜电子	1,174,429.00	2.55
521	000932	华菱钢铁	1,171,715.00	2.54
522	600114	东睦股份	1,154,010.00	2.50
523	300655	晶瑞电材	1,149,371.00	2.49
524	000603	盛达资源	1,141,130.00	2.48
525	603690	至纯科技	1,141,085.00	2.48
526	300785	值得买	1,137,756.00	2.47
527	300403	汉宇集团	1,126,983.00	2.45
528	002229	鸿博股份	1,125,137.00	2.44
529	300344	立方数科	1,119,622.00	2.43
530	300379	东方通	1,110,585.00	2.41
531	600266	城建发展	1,110,500.00	2.41
532	300578	会畅通讯	1,099,167.00	2.39
533	688516	奥特维	1,095,586.00	2.38
534	300737	科顺股份	1,094,367.00	2.38
535	300274	阳光电源	1,074,834.00	2.33
536	300757	罗博特科	1,072,243.00	2.33
537	002043	兔宝宝	1,057,536.00	2.30
538	688226	威腾电气	1,047,840.00	2.27
539	301080	百普赛斯	1,047,825.00	2.27
540	688711	宏微科技	1,043,088.16	2.26
541	688486	龙迅股份	1,033,459.40	2.24
542	688368	晶丰明源	1,023,128.47	2.22
543	600258	首旅酒店	1,023,047.00	2.22

544	688337	普源精电	1,022,363.16	2.22
545	603583	捷昌驱动	1,005,976.00	2.18
546	601001	晋控煤业	1,005,212.00	2.18
547	002583	海能达	999,100.00	2.17
548	002608	江苏国信	995,419.00	2.16
549	601233	桐昆股份	992,623.00	2.15
550	688458	美芯晟	992,599.25	2.15
551	001308	康冠科技	991,860.00	2.15
552	000983	山西焦煤	991,235.00	2.15
553	688662	富信科技	977,035.80	2.12
554	688550	瑞联新材	976,297.29	2.12
555	300559	佳发教育	970,906.00	2.11
556	002532	天山铝业	968,320.00	2.10
557	688225	亚信安全	960,643.57	2.09
558	002421	达实智能	954,428.00	2.07
559	688259	创耀科技	953,520.00	2.07
560	688676	金盘科技	949,994.22	2.06
561	688373	盟科药业	943,765.29	2.05
562	000333	美的集团	936,323.00	2.03
563	300847	中船汉光	927,123.00	2.01
564	002138	顺络电子	924,326.00	2.01
565	002600	领益智造	921,900.00	2.00

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,781,107,899.00
卖出股票收入（成交）总额	2,833,427,685.41

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

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	499,747,857.14	35.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	82,354,279.45	5.79
	其中：政策性金融债	82,354,279.45	5.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	259,715,127.41	18.25
9	其他	-	-
10	合计	841,817,264.00	59.15

**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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	239980	23贴现国债80	5,000,000	499,747,857.14	35.11
2	210202	21国开02	800,000	82,354,279.45	5.79
3	112372493	23蒙商银行CD063	500,000	49,981,451.61	3.51
4	112373152	23达州银行CD104	300,000	29,974,304.52	2.11
5	112373328	23达州银行CD105	300,000	29,973,615.48	2.11

**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 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 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中，23吉林亿联银行CD037、23吉林亿联银行CD034、23吉林亿联银行CD032的发行主体在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局吉林监管局的处罚。**

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**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	364,166.57
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,194.49
6	其他应收款	-



7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	386,361.06

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
天治 研究 驱动 混合A	2,3 39	10,687.69	22,826.67	0.09%	24,975,686.32	99.91%
天治 研究 驱动 混合C	3,2 78	291,155.89	940,894,038.61	98.5 8%	13,514,979.95	1.42%
合计	5,6 17	174,364.88	940,916,865.28	96.0 7%	38,490,666.27	3.93%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，计算结果保留小数点后4位，第5位四舍五入。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	天治研究驱动混合A	29,889.52	0.12%
	天治研究驱动混合C	15,870.49	0.00%
	合计	45,760.01	0.00%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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情况

项目	份额级别	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	天治研究驱动混合A	0~10
	天治研究驱动混合C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	天治研究驱动混合A	0~10
	天治研究驱动混合C	0~10
	合计	0~10

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	天治研究驱动混合A	天治研究驱动混合C
基金合同生效日(2015年06月09日)基金份额总额	28,704,949.30	-
本报告期期初基金份额总额	16,330,277.24	10,708,704.05
本报告期基金总申购份额	56,062,154.25	1,093,667,030.09
减：本报告期基金总赎回份额	47,393,918.50	149,966,715.58
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,998,512.99	954,409,018.56

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 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，基金管理人发生以下重大人事变动：

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

2、2023年3月22日，许家涵先生任职公司副总经理。

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

4、2023年12月16日，许家涵先生任职公司总经理、财务负责人，赵正中先生任职公司首席信息官；许家涵先生离任公司副总经理；马铁刚先生不再代任公司总经理、财务负责人、首席信息官职务。

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

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来，未变更过会计师事务所。

本报告年度聘任会计师事务所的报酬为2.5万元整。目前的审计机构-安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已提供审计服务的连续年限为自2011年12月28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

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 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	
东吴证券	1	819,639,373.67	14.60%	755,133.86	14.47%	-
开源证券	1	563,904,317.05	10.04%	527,243.19	10.10%	-
首创证券	1	467,270,162.25	8.32%	433,644.70	8.31%	-
中泰证券	1	526,863,908.07	9.38%	494,054.72	9.47%	-
德邦证券	2	1,956,745,414.77	34.85%	1,821,942.97	34.91%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	410,075,981.08	7.30%	381,050.01	7.30%	-

中银国际	2	869,877,371.28	15.49%	805,186.28	15.43%	-
------	---	----------------	--------	------------	--------	---

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

## 2、基金专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

3、本基金本报告期内租用券商交易单元的变更情况：新增德邦证券交易单元2个、开源证券交易单元1个、东吴证券交易单元1个、中泰证券交易单元1个、首创证券交易单元1个。

## 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	75,000,000.00	78.85%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	20,112,000.00	21.15%	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---	---	---

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天治基金管理有限公司旗下基金增加泰信财富为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-01-18
2	天治基金管理有限公司旗下基金2022年第4季度报告提示性公告、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
3	天治基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-02-15
4	天治基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2023-03-22
5	天治基金管理有限公司旗下基金2022年年度报告提示性公告、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-24
6	天治基金管理有限公司旗下基金2023年第1季度报告提示性公告、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
7	天治基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-06-17
8	天治基金管理有限公司旗下基金2023年第2季度报告提示性公告、天治研究驱动灵	中国证监会规定媒介	2023-07-20

	活配置混合型证券投资基金 2023年第2季度报告		
9	天治基金管理有限公司旗下 基金2023年中期报告提示性 公告、天治研究驱动灵活配 置混合型证券投资基金2023 年中期报告	中国证监会规定媒介	2023-08-29
10	天治基金管理有限公司旗下 基金2023年第3季度报告提 示性公告、天治研究驱动灵 活配置混合型证券投资基金 2023年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2023-10-25
11	天治基金管理有限公司旗下 基金增加阳光人寿为代销机 构、开通定期定额投资、基 金转换业务并参加费率优惠 活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-11-21
12	天治研究驱动灵活配置混合 型证券投资基金基金经理变 更公告	中国证监会规定媒介	2023-11-23
13	天治基金管理有限公司关于 旗下公开募集证券投资基金 可投资于北京证券交易所上 市股票及相关风险提示的公 告	中国证监会规定媒介	2023-11-23
14	天治研究驱动灵活配置混合 型证券投资基金更新的招募 说明书、天治研究驱动灵活 配置混合型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要 更新、天治研究驱动灵活配 置混合型证券投资基金(C类 份额)基金产品资料概要更 新	中国证监会规定媒介	2023-11-24

15	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加中正达广为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-11-24
16	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加普益基金为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-11-27
17	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加排排网财富为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-12-01
18	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加海银基金为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-12-04
19	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加坤元基金为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-12-05
20	天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-12-07
21	天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2023-12-09



	更新、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新		
22	天治基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-12-18
23	天治基金管理有限公司关于提高旗下部分基金估值精度并修订基金合同及托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2023-12-26
24	天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书	中国证监会规定媒介	2023-12-26
25	天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金分红公告	中国证监会规定媒介	2023-12-28

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20231201-20231203	0.00	55,095,867.77	0.00	55,095,867.77	5.63%
	2	20231204-20231204	0.00	132,230,853.99	0.00	132,230,853.99	13.50%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在持有基金份额超过20%的持有人，存在持有人大额赎回带来的流动性风险。根据份额持有人的结构和特点，本基金的投资组合已经根据其可能产生的流动性风险作出相应调整，现有投资组合中流动性较好的资产比例较高，20%以上份额持有人的大额赎回对本基金的流动性影响有限。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1.中国证监会准予天治稳定收益债券型证券投资基金变更注册为天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金的文件

2.《天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3.《天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4.《天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

5.基金管理人业务资格批件、营业执照

6.报告期内天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿

### 13.2 存放地点

天治基金管理有限公司办公地点-上海市云锦路701号西岸智塔东塔19楼。

### 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  
二〇二四年三月二十七日