

# 天治新消费灵活配置混合型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:天治基金管理有限公司

基金托管人:上海银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	48
§9 开放式基金份额变动 .....	49
§10 重大事件揭示 .....	49
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
§12 备查文件目录 .....	52
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	53

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天治新消费灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	天治新消费混合
基金主代码	350008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年07月06日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,046,719.76份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天治基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	姚静静	周直毅
	联系电话	021-60371155	021-68475608
	电子邮箱	yaojj@chinanature.com.cn	custody@bosc.cn
客户服务电话		400-098-4800（免长途通话费用）、021-60374800	95594
传真		021-60374934	021-68476901
注册地址		上海市徐汇区丰谷路315弄24号1-3层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号
办公地址		上海市徐汇区云锦路701号西岸智塔东塔楼19层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号27层
邮政编码		200232	200120
法定代表人		马铁刚	金煜

### 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天治基金管理有限公司	上海市徐汇区云锦路701号西岸智塔东塔19楼

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	本期已实现收益	-863,695.65
本期利润	-1,582,275.39	
加权平均基金份额本期利润	-0.1943	
本期加权平均净值利润率	-16.79%	
本期基金份额净值增长率	-16.54%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
	期末可供分配利润	-9,542.55
	期末可供分配基金份额利润	-0.0012
	期末基金资产净值	8,037,177.21
	期末基金份额净值	0.9988
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	-41.42%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

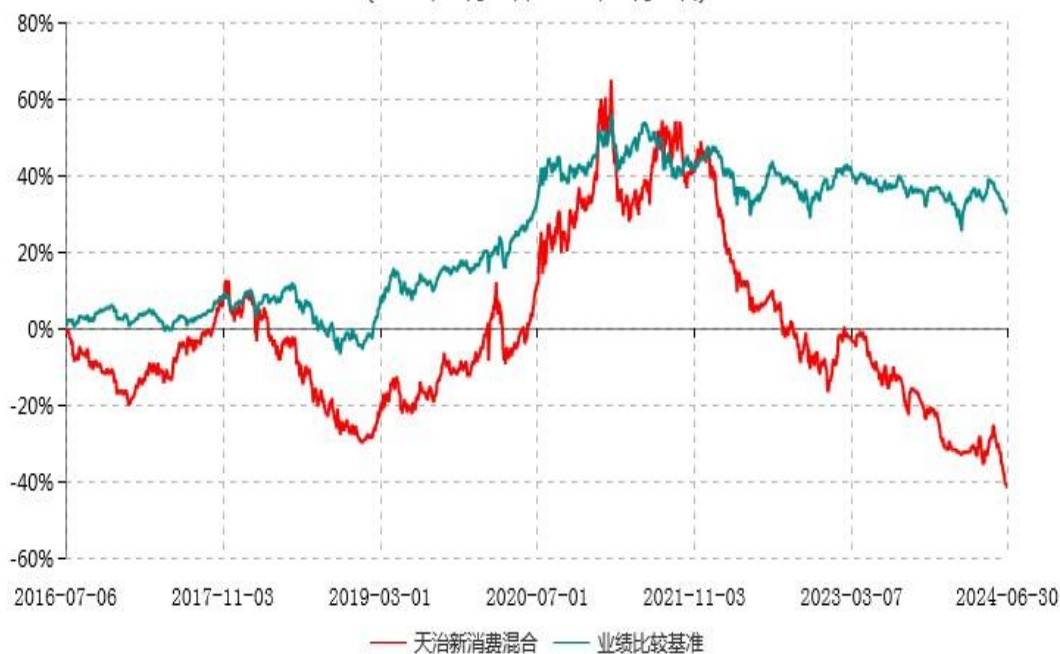
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-14.60%	1.36%	-3.85%	0.32%	-10.75%	1.04%
过去三个月	-14.67%	1.60%	-3.61%	0.44%	-11.06%	1.16%
过去六个月	-16.54%	1.22%	-3.92%	0.55%	-12.62%	0.67%
过去一年	-30.64%	1.18%	-5.01%	0.49%	-25.63%	0.69%
过去三年	-60.19%	1.24%	-13.74%	0.58%	-46.45%	0.66%
自基金合同生效起至今	-41.42%	1.30%	30.01%	0.62%	-71.43%	0.68%

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

天治新消费灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年07月06日-2024年06月30日)



### 3.3 其他指标



注：无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人--天治基金管理有限公司于2003年5月成立，注册资本1.6亿元，注册地为上海。公司股权结构为：吉林省信托有限责任公司出资9800万元，占注册资本的61.25%；中国吉林森林工业集团有限责任公司出资6200万元，占注册资本的38.75%。截至2024年6月30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、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金（转型自2011年12月28日生效的天治稳定收益债券型证券投资基金）、天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金（转型自2008年5月8日生效的天治创新先锋混合型证券投资基金）、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金（转型自2005年1月12日生效的天治品质优选混合型证券投资基金）、天治鑫利纯债债券型证券投资基金（转型自2016年12月7日生效的天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金）、天治转型升级混合型证券投资基金、天治量化核心精选混合型证券投资基金、天治天享66个月定期开放债券型证券投资基金、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、2015年6月9日、2016年4月7日、2016年4月18日、2019年3月7日、2019年5月21日、2019年6月11日、2021年09月16日、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		
梁莉	研究发展部副总监、本基金基金经理、天治中国制造2025灵活配置混合型证券	2022-01-18	-	13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

	投资基金基金经理、 天治趋势精选灵活 配置混合型证券投资 基金基金经理、天 治研究驱动灵活配 置混合型证券投资 基金基金经理				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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司《公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》。本基金管理人公平交易体系涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，并通过明确投资权限划分、建立统一研究报告管理平台、分层次建立适用全公司及各投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库、应用投资管理系统公平交易相关程序、定期对不同投资组合收益率差异、交易价差、成交量事后量化分析评估等一系列措施切实落实各项公平交易制度。

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发生“所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%”的情形。

报告期内，本基金管理人未发现异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国内经济偏弱、海外经济修复以及美联储货币政策不确定性是影响上半年大类资产的重要因素。上半年海外经济好于预期，全球制造业PMI处于荣枯线以上，纳斯达克指数和日经指数涨幅居前，国内主要指数表现偏弱，创业板跌幅较大。海外经济修复叠加美联储降息预期催化，大宗商品多数上涨，其中，铜、原油和黄金涨幅居前，农产品表现偏弱。上半年美债利率相对年初小幅上行，国内经济偏弱，十年期国债利率低位震荡。

上半年国内经济分化，地产、消费相对低迷，受地方政府化债以及专项债发行偏慢影响，基建投资增速较弱，出口和制造业投资景气度维持相对高位。应对地产下行压力，上半年地产需求端刺激政策密集出台，主要城市均调整了限购限贷和房贷利率，鼓励地方政府保交楼、商品房收储、“以旧换新”等，6月地产销量短期改善，持续性有待观察。外需修复及设备更新改造政策带动制造业投资上半年维持高位，受益于海外经济修复、补库存以及低基数，年初至今我国出口持续改善，近几个月国内出口数据超市场预期。受收入预期和预防性储蓄增加等因素影响，上半年国内整体消费数据较差，消费信心恢复仍需提振。

上半年，本基金重点围绕生猪养殖板块做重点布局。进入三季度，供应端仍然有23年冬季疫病带来的影响，生猪供应量仍处于低位。需求端度过二季度季节性淡季逐渐回暖，供需缺口有望进一步拉大。同时二次育肥的再次入场有望继续推高猪价，三季度猪价大概率超过6月高点达到新高。从投资角度看，当下生猪养殖板块回调至较低位置，市场未给公司本轮周期合理定价水平。三季度随着猪价上涨以及季报业绩确定性催化下，股价存在向上修复机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末天治新消费混合基金份额净值为0.9988元，本报告期内，基金份额净值增长率为-16.54%，同期业绩比较基准收益率为-3.92%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内地产进入新的均衡周期以及地方政府化债背景下，总量经济向上弹性有限，但新质生产力相关领域预计维持较高的景气度，高技术产业增加值和固定资产投资维持较快的增速。预计下半年出口仍然是景气度相对较好的方向，短期海外经济复苏面临一定曲折但仍有韧性，国内制造业比较优势显著，外需和补库存对国内出口仍有支撑，关注美国大选贸易摩擦对出口扰动。美联储进入降息周期，美元指数和美债利率下行，中美利差收窄，人民币贬值压力缓解，国内货币政策空间将进一步打开。随着

全球范围内降息央行的数量逐步增加，金融条件总体趋于宽松，全球制造业短期复苏有一定波折但处于相对底部区域，从中期来看，随着货币环境的进一步改善，全球制造业中期仍维持上行趋势。逆全球化以及国内总量经济缺乏弹性情形下，A股市场预计主要以结构性机会为主。

下半年，本基金将继续重点围绕大消费板块，例如生猪养殖、食品饮料、医药、家电等板块做重点配置，并严格对市场中的各项风险做好评估和控制，在控制好基金回撤的基础上，不断动态调整组合个股的风险收益比来获取超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人的基金估值和会计核算由基金结算部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制。基金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基金行业从业经验。公司估值委员会对于权益投资部、固定收益部及产品开发与金融工程部提交的估值模型和估值结果进行论证审核，并签署最终意见。基金经理会参与估值，与产品开发与金融工程部一同根据估值模型、估值程序计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，将估值结果提交公司估值委员会。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

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

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：天治新消费灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	549,379.75	1,926,045.73
结算备付金		118,801.18	106,134.37
存出保证金		30,200.55	36,023.83
交易性金融资产	6.4.7.2	7,467,468.00	6,604,111.00

其中：股票投资		7,467,468.00	6,604,111.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		272,814.60	1,100,880.07
应收股利		-	-
应收申购款		14,732.94	429.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		8,453,397.02	9,773,624.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		200,550.91	-
应付赎回款		119,816.73	82.41
应付管理人报酬		8,853.55	9,925.23
应付托管费		1,475.58	1,654.19
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	85,523.04	104,311.23
负债合计		416,219.81	115,973.06
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	8,046,719.76	8,070,211.60
未分配利润	6.4.7.8	-9,542.55	1,587,439.71
净资产合计		8,037,177.21	9,657,651.31
负债和净资产总计		8,453,397.02	9,773,624.37

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额净值0.9988元，基金份额总额8,046,719.76份。

## 6.2 利润表

会计主体：天治新消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		-1,497,657.40	-299,686.13
1.利息收入		14,677.95	11,024.80
其中：存款利息收入	6.4.7.9	14,677.95	11,024.80
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-796,721.28	452,747.47
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-835,573.74	388,484.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	38,852.46	64,263.07
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-718,579.74	-766,059.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,965.67	2,601.21
<b>减：二、营业总支出</b>		84,617.99	135,688.22
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	56,175.87	97,835.61
2.托管费	6.4.10.2.2	9,362.64	16,305.92
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.19	19,079.48	21,546.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,582,275.39	-435,374.35
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,582,275.39	-435,374.35
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,582,275.39	-435,374.35

### 6.3 净资产变动表

会计主体：天治新消费灵活配置混合型证券投资基金



本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	8,070,211.60	1,587,439.71	9,657,651.31
二、本期期初净资产	8,070,211.60	1,587,439.71	9,657,651.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-23,491.84	-1,596,982.26	-1,620,474.10
（一）、综合收益总额	-	-1,582,275.39	-1,582,275.39
（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）	-23,491.84	-14,706.87	-38,198.71
其中：1.基金申购款	1,974,452.56	337,361.91	2,311,814.47
2.基金赎回款	-1,997,944.40	-352,068.78	-2,350,013.18
（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、本期期末净资产	8,046,719.76	-9,542.55	8,037,177.21
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	8,163,983.22	4,011,393.12	12,175,376.34

产			
二、本期期初净资产	8,163,983.22	4,011,393.12	12,175,376.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-173,893.27	-496,015.64	-669,908.91
（一）、综合收益总额	-	-435,374.35	-435,374.35
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-173,893.27	-60,641.29	-234,534.56
其中：1.基金申购款	1,245,680.58	802,026.40	2,047,706.98
2.基金赎回款	-1,419,573.85	-862,667.69	-2,282,241.54
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	7,990,089.95	3,515,377.48	11,505,467.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

天治新消费灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系由天治成长精选混合型证券投资基金转型而来，天治成长精选混合型证券投资基金（原名天治成长

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

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

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

本基金的业绩比较基准为:申银万国消费品指数收益率 $\times$ 50%+中证全债指数收益率 $\times$ 50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证

监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2024年6月30日的财务状况以及2024年上半年的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与2023年年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；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流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

#### 6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	549,379.75
等于：本金	549,286.05
加：应计利息	93.70
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	549,379.75

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	8,495,904.73	-	7,467,468.00	-1,028,436.73
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	8,495,904.73	-	7,467,468.00	-1,028,436.73

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	228.83
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	57,528.93
其中：交易所市场	57,528.93
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	9,944.48
其他应付	17,820.80
合计	85,523.04

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,070,211.60	8,070,211.60
本期申购	1,974,452.56	1,974,452.56
本期赎回（以“-”号填列）	-1,997,944.40	-1,997,944.40
本期末	8,046,719.76	8,046,719.76

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。



**6.4.7.8 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,194,069.94	-6,606,630.23	1,587,439.71
本期期初	8,194,069.94	-6,606,630.23	1,587,439.71
本期利润	-863,695.65	-718,579.74	-1,582,275.39
本期基金份额交易产生的变动数	-70,586.38	55,879.51	-14,706.87
其中：基金申购款	1,845,083.46	-1,507,721.55	337,361.91
基金赎回款	-1,915,669.84	1,563,601.06	-352,068.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,259,787.91	-7,269,330.46	-9,542.55

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	13,802.87
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	589.06
其他	286.02
合计	14,677.95

**6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	57,482,883.81
减：卖出股票成本总额	58,171,848.96
减：交易费用	146,608.59

买卖股票差价收入	-835,573.74
----------	-------------

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益--买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益--赎回差价收入。

##### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益--申购差价收入。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益--赎回差价收入。

##### 6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益--申购差价收入。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	38,852.46
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	38,852.46

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-718,579.74
——股票投资	-718,579.74
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	-718,579.74

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	2,965.67
合计	2,965.67

**6.4.7.18 信用减值损失**

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	9,944.48
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	135.00
账户维护费	9,000.00
合计	19,079.48

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

天治基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	56,175.87	97,835.61
其中：应支付销售机构的客户维护费	11,654.65	20,036.87
应支付基金管理人的净管理费	44,521.22	77,798.74

注：2023年8月5日前，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；自2023年8月5日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,362.64	16,305.92

注：2023年8月5日前，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；自2023年8月5日起，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2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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

注：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。

##### 6.4.10.4.2 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

注：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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 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

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

#### 6.4.10.6 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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	549,379.75	13,802.87	721,847.99	10,006.78

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2024年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的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。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金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。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有



的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年 06月30	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
-----------------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

日							
资产							
货币资金	549,379.75	-	-	-	-	-	549,379.75
结算备付金	118,801.18	-	-	-	-	-	118,801.18
存出保证金	30,200.55	-	-	-	-	-	30,200.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	7,467,468.00	7,467,468.00
应收清算款	-	-	-	-	-	272,814.60	272,814.60
应收申购款	-	-	-	-	-	14,732.94	14,732.94
资产总计	698,381.48	-	-	-	-	7,755,015.54	8,453,397.02
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	200,550.91	200,550.91
应付赎回款	-	-	-	-	-	119,816.73	119,816.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,853.55	8,853.55
应付托管费	-	-	-	-	-	1,475.58	1,475.58
其他负债	-	-	-	-	-	85,523.04	85,523.04
负债总计	-	-	-	-	-	416,219.81	416,219.81
利率敏感度缺口	698,381.48	-	-	-	-	7,338,795.73	8,037,177.21
上年度末 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	1,926,045.73	-	-	-	-	-	1,926,045.73

金							
结算备付金	106,134.37	-	-	-	-	-	106,134.37
存出保证金	36,023.83	-	-	-	-	-	36,023.83
交易性金融资产	-	-	-	-	-	6,604,111.00	6,604,111.00
应收清算款	-	-	-	-	-	1,100,880.07	1,100,880.07
应收申购款	-	-	-	-	-	429.37	429.37
资产总计	2,068,203.93	-	-	-	-	7,705,420.44	9,773,624.37
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	82.41	82.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,925.23	9,925.23
应付托管费	-	-	-	-	-	1,654.19	1,654.19
其他负债	-	-	-	-	-	104,311.23	104,311.23
负债总计	-	-	-	-	-	115,973.06	115,973.06
利率敏感度缺口	2,068,203.93	-	-	-	-	7,589,447.38	9,657,651.31

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023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	7,467,468.00	92.91	6,604,111.00	68.38
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	7,467,468.00	92.91	6,604,111.00	68.38

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：

		人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	398,574.65	863,726.76
	业绩比较基准变动-5%	-398,574.65	-863,726.76

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	7,467,468.00	6,604,111.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	7,467,468.00	6,604,111.00

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,467,468.00	88.34
	其中：股票	7,467,468.00	88.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	668,180.93	7.90
8	其他各项资产	317,748.09	3.76
9	合计	8,453,397.02	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,004,817.00	49.83
B	采矿业	-	-

C	制造业	3,423,453.00	42.60
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,060.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	31,138.00	0.39
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	7,467,468.00	92.91

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002714	牧原股份	15,900	693,240.00	8.63
2	300498	温氏股份	34,500	683,790.00	8.51
3	002100	天康生物	97,500	675,675.00	8.41
4	002840	华统股份	40,200	666,918.00	8.30

5	002567	唐人神	124,200	665,712.00	8.28
6	000876	新希望	72,800	665,392.00	8.28
7	300761	立华股份	29,100	658,824.00	8.20
8	605296	神农集团	18,700	657,305.00	8.18
9	603477	巨星农牧	22,500	645,750.00	8.03
10	600975	新五丰	88,400	624,988.00	7.78
11	002311	海大集团	8,500	399,925.00	4.98
12	688526	科前生物	11,000	161,590.00	2.01
13	000529	广弘控股	23,300	137,004.00	1.70
14	002299	圣农发展	3,000	40,920.00	0.51
15	600809	山西汾酒	100	21,088.00	0.26
16	000568	泸州老窖	100	14,349.00	0.18
17	603199	九华旅游	400	11,920.00	0.15
18	000524	岭南控股	1,000	8,060.00	0.10
19	600054	黄山旅游	700	7,854.00	0.10
20	002033	丽江股份	800	7,008.00	0.09
21	603833	欧派家居	100	5,356.00	0.07
22	002572	索菲亚	300	4,599.00	0.06
23	000888	峨眉山A	400	4,356.00	0.05
24	603816	顾家家居	100	3,229.00	0.04
25	603801	志邦家居	200	2,616.00	0.03

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600975	新五丰	2,296,174.00	23.78
2	002100	天康生物	2,036,792.00	21.09
3	002567	唐人神	2,033,990.00	21.06



4	300498	温氏股份	1,816,624.00	18.81
5	603477	巨星农牧	1,809,019.00	18.73
6	002714	牧原股份	1,756,444.20	18.19
7	605296	神农集团	1,709,646.00	17.70
8	002840	华统股份	1,669,541.00	17.29
9	600201	生物股份	1,595,710.00	16.52
10	300761	立华股份	1,580,611.00	16.37
11	688526	科前生物	1,571,312.75	16.27
12	603151	邦基科技	1,563,635.00	16.19
13	002299	圣农发展	1,310,579.86	13.57
14	000876	新希望	1,121,242.00	11.61
15	603816	顾家家居	1,110,782.00	11.50
16	000529	广弘控股	1,096,739.00	11.36
17	000568	泸州老窖	1,092,232.00	11.31
18	603801	志邦家居	1,057,263.00	10.95
19	603833	欧派家居	1,049,183.00	10.86
20	002311	海大集团	1,010,994.00	10.47
21	002572	索菲亚	958,440.00	9.92
22	603566	普莱柯	928,554.00	9.61
23	600519	贵州茅台	837,597.00	8.67
24	002458	益生股份	760,693.00	7.88
25	600809	山西汾酒	725,714.00	7.51
26	600276	恒瑞医药	710,979.00	7.36
27	000858	五粮液	657,265.00	6.81
28	001201	东瑞股份	656,423.00	6.80
29	688581	安杰思	551,011.61	5.71
30	600054	黄山旅游	448,032.00	4.64
31	000048	京基智农	431,613.00	4.47
32	600690	海尔智家	387,141.00	4.01
33	601939	建设银行	359,905.00	3.73
34	603868	飞科电器	333,673.00	3.46

35	600030	中信证券	329,212.00	3.41
36	000002	万科A	328,170.00	3.40
37	000524	岭南控股	327,888.00	3.40
38	601988	中国银行	324,140.00	3.36
39	000001	平安银行	319,685.00	3.31
40	002142	宁波银行	319,492.00	3.31
41	601688	华泰证券	317,969.00	3.29
42	600195	中牧股份	315,240.00	3.26
43	600383	金地集团	296,275.00	3.07
44	002244	滨江集团	294,080.00	3.05
45	601398	工商银行	280,070.00	2.90
46	601995	中金公司	275,304.00	2.85
47	601336	新华保险	273,751.00	2.83
48	601288	农业银行	267,220.00	2.77
49	300244	迪安诊断	263,303.00	2.73
50	300059	东方财富	261,860.00	2.71
51	603136	天目湖	260,941.00	2.70
52	600109	国金证券	259,850.00	2.69
53	601059	信达证券	258,734.00	2.68
54	002959	小熊电器	258,005.00	2.67
55	601628	中国人寿	253,452.00	2.62
56	000776	广发证券	253,098.00	2.62
57	601108	财通证券	250,316.00	2.59
58	600999	招商证券	249,822.00	2.59
59	601162	天风证券	249,500.00	2.58
60	601658	邮储银行	249,380.00	2.58
61	002966	苏州银行	244,730.00	2.53
62	601555	东吴证券	244,220.00	2.53
63	601166	兴业银行	244,200.00	2.53
64	600958	东方证券	243,261.00	2.52
65	002159	三特索道	241,509.00	2.50

66	600926	杭州银行	239,494.00	2.48
67	600837	海通证券	236,790.00	2.45
68	600036	招商银行	235,995.00	2.44
69	600593	大连圣亚	235,159.00	2.43
70	300673	佩蒂股份	234,723.00	2.43
71	002500	山西证券	232,416.00	2.41
72	601128	常熟银行	228,100.00	2.36
73	300871	回盛生物	226,098.00	2.34
74	601788	光大证券	225,049.00	2.33
75	000783	长江证券	214,399.00	2.22
76	601328	交通银行	203,790.00	2.11
77	002688	金河生物	199,124.00	2.06
78	300558	贝达药业	193,364.00	2.00

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600201	生物股份	1,645,893.00	17.04
2	603151	邦基科技	1,566,009.00	16.22
3	600975	新五丰	1,487,477.00	15.40
4	000568	泸州老窖	1,432,627.00	14.83
5	603816	顾家家居	1,413,352.00	14.63
6	688526	科前生物	1,412,293.93	14.62
7	603801	志邦家居	1,327,150.00	13.74
8	002100	天康生物	1,299,949.00	13.46
9	603833	欧派家居	1,286,327.00	13.32
10	002567	唐人神	1,247,698.00	12.92

11	002299	圣农发展	1,184,159.00	12.26
12	300498	温氏股份	1,156,981.00	11.98
13	002714	牧原股份	1,084,224.00	11.23
14	002572	索菲亚	1,052,917.00	10.90
15	605296	神农集团	1,050,576.80	10.88
16	603477	巨星农牧	1,049,586.00	10.87
17	600276	恒瑞医药	1,016,958.00	10.53
18	600519	贵州茅台	994,277.00	10.30
19	000858	五粮液	990,113.00	10.25
20	600809	山西汾酒	979,864.00	10.15
21	300761	立华股份	960,521.00	9.95
22	603566	普莱柯	946,594.00	9.80
23	002840	华统股份	898,860.00	9.31
24	000529	广弘控股	850,448.90	8.81
25	002458	益生股份	687,045.00	7.11
26	600690	海尔智家	674,823.00	6.99
27	001201	东瑞股份	576,152.00	5.97
28	002311	海大集团	575,935.00	5.96
29	300558	贝达药业	548,743.00	5.68
30	688581	安杰思	540,931.38	5.60
31	600054	黄山旅游	460,440.00	4.77
32	000876	新希望	426,876.00	4.42
33	688276	百克生物	411,058.08	4.26
34	603259	药明康德	392,351.00	4.06
35	000048	京基智农	377,992.00	3.91
36	601939	建设银行	360,936.00	3.74
37	600048	保利发展	352,190.00	3.65
38	603868	飞科电器	335,441.00	3.47
39	000524	岭南控股	325,480.00	3.37
40	601988	中国银行	325,444.00	3.37
41	000001	平安银行	321,915.00	3.33

42	000002	万科A	319,525.00	3.31
43	002142	宁波银行	313,760.00	3.25
44	600030	中信证券	310,860.00	3.22
45	601688	华泰证券	307,400.00	3.18
46	000661	长春高新	300,808.00	3.11
47	600383	金地集团	295,465.00	3.06
48	600195	中牧股份	294,360.00	3.05
49	002244	滨江集团	293,421.00	3.04
50	601398	工商银行	282,320.00	2.92
51	603008	喜临门	271,863.00	2.82
52	601288	农业银行	269,990.00	2.80
53	603136	天目湖	268,870.00	2.78
54	601995	中金公司	268,290.00	2.78
55	601336	新华保险	264,736.00	2.74
56	300737	科顺股份	257,444.00	2.67
57	603233	大参林	256,233.00	2.65
58	002959	小熊电器	255,165.00	2.64
59	601059	信达证券	252,483.00	2.61
60	300059	东方财富	252,260.00	2.61
61	600109	国金证券	251,140.00	2.60
62	601658	邮储银行	250,077.00	2.59
63	002966	苏州银行	249,850.00	2.59
64	600999	招商证券	247,150.00	2.56
65	300244	迪安诊断	247,116.00	2.56
66	300673	佩蒂股份	246,892.00	2.56
67	601166	兴业银行	246,810.00	2.56
68	601628	中国人寿	245,896.00	2.55
69	000776	广发证券	245,120.00	2.54
70	600926	杭州银行	243,589.00	2.52
71	601162	天风证券	242,940.00	2.52
72	601108	财通证券	242,394.00	2.51

73	600036	招商银行	241,965.00	2.51
74	603208	江山欧派	236,279.00	2.45
75	600958	东方证券	235,587.00	2.44
76	601555	东吴证券	233,920.00	2.42
77	002159	三特索道	232,155.00	2.40
78	603737	三棵树	228,125.00	2.36
79	600837	海通证券	228,020.00	2.36
80	603378	亚士创能	227,585.00	2.36
81	002500	山西证券	226,304.00	2.34
82	601128	常熟银行	225,042.00	2.33
83	601788	光大证券	219,859.00	2.28
84	600593	大连圣亚	217,406.00	2.25
85	300871	回盛生物	209,015.00	2.16
86	000783	长江证券	206,800.00	2.14
87	601328	交通银行	205,308.00	2.13
88	002688	金河生物	195,190.00	2.02
89	002791	坚朗五金	194,351.00	2.01

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	59,753,785.70
卖出股票收入（成交）总额	57,482,883.81

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

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

**7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。**

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	30,200.55
2	应收清算款	272,814.60
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,732.94

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	317,748.09

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(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
584	13,778.63	29,646.37	0.37%	8,017,073.39	99.63%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	27,430.39	0.34%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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



本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年07月06日)基金份额总额	28,475,095.52
本报告期期初基金份额总额	8,070,211.60
本报告期基金总申购份额	1,974,452.56
减：本报告期基金总赎回份额	1,997,944.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,046,719.76

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	1	60,571,016.64	51.67%	57,293.28	51.92%	-
国信证券	1	2,170,437.51	1.85%	2,052.99	1.86%	-
海通证券	1	54,495,215.36	46.48%	51,002.19	46.22%	-

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无变更情况。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权	成交金额	占当期基

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例		金成交总 额的比例
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加万得基金为代销机构、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	中国证监会指定媒介	2024-01-05
2	天治基金管理有限公司旗下基金增加奕丰基金为代销机构、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	中国证监会指定媒介	2024-01-15
3	天治旗下十五只基金 2023年 第 4 季度报告汇总	中国证监会指定媒介	2024-01-19
4	天治基金管理有限公司旗下基金增加宁波银行为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2024-02-23
5	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2024-03-22
6	天治旗下十五只基金 2023年	中国证监会指定媒介	2024-03-27

	年度报告汇总		
7	天治旗下十五只基金 2024年第 1 季度报告汇总	中国证监会指定媒介	2024-04-20
8	天治新消费灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2024-06-20

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20240101-20240630	3,262,174.05	0.00	0.00	3,262,174.05	40.54%
产品特有风险							
<p>本基金报告期内有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在持有人一次性赎回带来的流动性风险。根据份额持有人的结构和特点，本基金的投资组合已经根据其可能产生的流动性风险做出相应调整，减少流动性不佳资产的配置，增加流动性较好资产的配置，目前组合中流动性较好的资产比例较高，20%以上份额持有人一次性赎回对本基金的流动性影响有限。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予天治成长精选混合型证券投资基金变更注册为天治新消费灵活配置混合型证券投资基金的文件
- 2.《天治新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3.《天治新消费灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4.《天治新消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6.报告期内天治新消费灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿

### 12.2 存放地点

天治基金管理有限公司办公地点-上海市云锦路701号西岸智塔东塔19楼。

### 12.3 查阅方式

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

2.网站查询：[www.chinanature.com.cn](http://www.chinanature.com.cn)

天治基金管理有限公司  
二〇二四年八月二十九日