

# 天治稳健双鑫债券型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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:交通银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021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	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
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	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	42
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	42
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	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	43
§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
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.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天治稳健双鑫债券型证券投资基金
基金简称	天治稳健双鑫债券
基金主代码	007929
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年11月20日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,672,904.62份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过合理的动态资产配置，从而控制组合风险。通过积极主动的投资管理，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将采用严格的仓位控制策略，随着参照指数的平均市盈率累积到一定阈值之后，本基金将按照纪律逐渐降低股票仓位上限，从而确保基金能够部分锁定收益；在参照指数的平均市盈率下跌超过一定的阈值下限时，本基金将按照纪律逐渐增加股票仓位上限，从而为基金争取更大的潜在收益。债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。本基金将采取“自下而上”的方式精选个股。本基金将全面考察上市公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本面特征，同时综合利用市盈率（P/E）、市净率（P/B）和折现现金流（DCF）等估值方法对公司的投资价值进行分析和比较，挖掘具备中长期持续增长的上市公司股票库，以获得较高投资回报。</p>

业绩比较基准	中证全债指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，长期预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵正中
	联系电话	021-60371155
	电子邮箱	zhaozz@chinanature.com.cn
客户服务电话	400-098-4800(免长途通话费用)、021-60374800	95559
传真	021-60374934	021-62701216
注册地址	上海市浦东新区莲振路298号4号楼231室	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址	上海市复兴西路159号	中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码	200031	200336
法定代表人	单宇	任德奇

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天治基金管理有限公司	上海市复兴西路159号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	1,163,908.06
本期利润	155,904.30
加权平均基金份额本期利润	0.0081
本期加权平均净值利润率	0.75%
本期基金份额净值增长率	-0.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	724,219.13
期末可供分配基金份额利润	0.0679
期末基金资产净值	11,397,123.75
期末基金份额净值	1.0679
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	6.79%

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	-0.60%	0.38%	-0.04%	0.09%	-0.56%	0.29%
过去三个月	-0.19%	0.28%	1.56%	0.11%	-1.75%	0.17%
过去六个月	-0.27%	0.31%	2.20%	0.14%	-2.47%	0.17%
过去一年	6.09%	0.37%	5.11%	0.14%	0.98%	0.23%
自基金合同 生效起至今	6.79%	0.37%	9.10%	0.14%	-2.31%	0.23%

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

天治稳健双鑫债券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

(2019年11月20日-2021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2021年6月30日，本基金管理人旗下共有十四只开放式基金，除本基金外，另外十三只基金—天治财富增长证券投资基金、天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）、天治天得利货币市场基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、天治可转债增强债券型证券投资基金、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金（转型自2011年12月28日生效的天治稳定收益债券型证券投资基金）、天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金（转型自2008年5月8日生效的天治创新先锋混合型证券投资基金）、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金（转型自2005年1月12日生效的天治品质优选混合型证券投资基金）、天治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、2016年7月6日、2019年3月7日、2019年5月21日、2019年6月11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		
王洋	公司投资副总监兼固定收益部总监、本基金基金经理、天治可转债增强债券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	2019-11-20	-	14年	数量经济学硕士研究生，具有基金从业资格，曾任天治基金管理有限公司交易员、研究员、基金经理助理。

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

离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，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《天治稳健双鑫债券型证券投资基金基金合同》、《天治稳健双鑫债券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

2021年上半年，由于国内外宏观有显著的波动，股票市场及债券市场均经历了较大起伏。

央行上半年货币政策总体温 and，三季度伊始调降存款准备金，为下半年定中性偏松政策基调。宏观经济方面，上半年出口继续保持高增，但投资、消费出现恢复瓶颈。

从海外来看，欧美上半年经济逐步修复，带动全球需求回暖，但印度疫情大爆发，对全球产业链构成显著负面影响。在需求复苏供给受限的背景下，大宗商品价格上涨，引发市场对于通胀及美联储货币政策转向的担忧，根据最新的美联储货币政策表态，货币政策转向的倾向性确有提高。

从市场的情况来看，上半年流动性整体较为充裕，二季度好于一季度，市场利率总体下行，降准之后，10年国债下行到3%以下，至2.95%附近。

在这样一个市场环境和宏观背景下，稳健双鑫调整了组合配置结构和思路，动态调整权益仓位，调整了纯债组合结构，逢低增配了优质个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末天治稳健双鑫债券基金份额净值为1.0679元，本报告期内，基金份额净值增长率为-0.27%，同期业绩比较基准收益率为2.20%，低于同期业绩比较基准收益率2.47%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

**宏观经济：**国内方面，严控房地产及约束地方政府债务将对抑制下半年总体投资需求，后疫情经济中，居民收入预期尚未恢复到疫情前水平，将抑制消费活动，预计下半年社消总体保持弱势。海外来看，欧美社会活动逐渐全面开放，预计对我国出口将产生正面影响，但美国解封与财政补贴退坡将相继展开，后续美国经济是否能保持目前增速有待观察。这将对我国出口产生负面影响。

**货币政策：**央行在三季度伊始全面降准，旨在降低实际利率，降低中国企业融资成本提升国际竞争力，预计下半年货币政策将维持偏松态势，流动性将保持较为充裕格局。美联储方面，美联储在第二季度的多次议息会议上持续提到TAPER，预计今年四季度大概率提上实际议程，但美国经济恢复前景尤其就业前景仍存在不确定性，抑制美联储货币政策节奏。

**市场：**从估值上看，债券估值好于权益，随着经济的走弱和货币政策的宽松，预计无风险利率大概率下行，利率债投资价值更优，信用债受制于信用风险持续暴露带来的信用分层，高等级信用债估值并无明显优势。在权益资产方面，可转债受益于流动性宽松，估值抬升大概率好于股票市场，股票市场中，确定性高的核心资产在无风险利率下行过程中有望出现估值提升。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人的基金估值和会计核算由基金结算部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制。基金会计均具备基金从业资格。为确保基金资产估值的公平、合理、

合规，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了天治基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了有关议事规则。估值委员会成员包括公司投资决策委员会成员、负责基金结算的管理层、监察稽核部总监、产品开发与金融工程部总监等，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对于权益投资部、量化投资部、固定收益部以及产品开发与金融工程部提交的估值模型和估值结果进行论证审核，并签署最终意见。基金经理会参与估值，与产品开发与金融工程部一同根据估值模型、估值程序计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，将估值结果提交公司估值委员会。

参与估值流程的各方还包括本基金托管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

报告期内，本基金存在连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，出现上述情形的时间段为2020年11月16日至2021年2月4日、2021年2月19日至2021年5月17日、2021年5月26日至2021年6月30日。

报告期内，本基金不存在基金持有人数少于200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

报告期内，基金托管人在天治稳健双鑫债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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，天治基金管理有限公司在天治稳健双鑫债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 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 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：天治稳健双鑫债券型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	105,254.41	100,610.74
结算备付金		160,719.08	263,157.76
存出保证金		5,409.80	33,037.39
交易性金融资产	6.4.7.2	13,223,734.30	28,186,911.34
其中：股票投资		2,227,764.40	3,962,987.34
基金投资		-	-
债券投资		10,995,969.90	24,223,924.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		271,315.12	77,256.08
应收利息	6.4.7.5	78,536.02	183,877.32
应收股利		-	-
应收申购款		-	1,049.16

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		13,844,968.73	28,845,899.79
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020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		2,200,000.00	2,000,000.00
应付证券清算款		109,147.25	-
应付赎回款		107,775.77	61,543.27
应付管理人报酬		7,389.20	17,035.78
应付托管费		2,111.20	4,867.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,273.17	21,030.05
应交税费		118.95	144.85
应付利息		391.80	384.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	12,637.64	150,090.52
负债合计		2,447,844.98	2,255,096.21
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	10,672,904.62	24,832,757.27
未分配利润	6.4.7.10	724,219.13	1,758,046.31
所有者权益合计		11,397,123.75	26,590,803.58
负债和所有者权益总计		13,844,968.73	28,845,899.79

注：（1）报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.0679元，基金份额总额10,672,904.62份。

（2）本基金基金合同于2019年11月20日生效。

## 6.2 利润表

会计主体：天治稳健双鑫债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		326,469.36	1,509,266.77
1. 利息收入		156,495.97	2,711,965.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	21,178.43	83,468.91
债券利息收入		129,723.27	2,614,410.15
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		5,594.27	14,086.78
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		1,117,028.09	-2,664,099.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	846,992.22	-3,883,380.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	262,416.62	425,000.83
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	7,619.25	794,280.25
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,008,003.76	1,400,953.17
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. 18	60, 949. 06	60, 447. 62
<b>减：二、费用</b>		170, 565. 06	2, 098, 318. 50
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	75, 936. 08	1, 247, 389. 29
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	21, 696. 10	356, 396. 91
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	26, 934. 30	254, 905. 77
5. 利息支出		12, 079. 86	141, 985. 25
其中：卖出回购金融资产支出		12, 079. 86	141, 985. 25
6. 税金及附加		79. 49	4, 162. 41
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	33, 839. 23	93, 478. 87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		155, 904. 30	-589, 051. 73
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		155, 904. 30	-589, 051. 73

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治稳健双鑫债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	24, 832, 757. 27	1, 758, 046. 31	26, 590, 803. 58
二、本期经营活动产生的基金净值变动	-	155, 904. 30	155, 904. 30



数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-14,159,852.65	-1,189,731.48	-15,349,584.13
其中:1.基金申购款	73,954,992.92	5,575,089.68	79,530,082.60
2.基金赎回款	-88,114,845.57	-6,764,821.16	-94,879,666.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	10,672,904.62	724,219.13	11,397,123.75
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	421,933,289.15	1,732,390.06	423,665,679.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-589,051.73	-589,051.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-143,052,788.69	702,060.94	-142,350,727.75
其中:1.基金申购款	670,507.01	-5,062.07	665,444.94
2.基金赎回款	-143,723,295.70	707,123.01	-143,016,172.69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-

(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	278,880,500.46	1,845,399.27	280,725,899.73

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：

徐克磊

闫译文

黄宇星

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

天治稳健双鑫债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可（2018）274号《关于准予天治稳健双鑫债券型证券投资基金注册的批复》及机构部函（2019）2065号《关于天治稳健双鑫债券型证券投资基金延期募集备案的回函》的核准，由基金管理人天治基金管理有限公司自2019年10月14日至2019年11月15日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2019）验字第60467615\_B04号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年11月20日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币472,255,903.40元，在募集期间产生的存款利息为人民币42,936.62元，以上实收基金（本息）合计为人民币472,298,840.02元，折合472,298,840.02份基金份额。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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要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（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券（含非公开发行公司债券）、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债、证券公司发行的短期公司债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中小企业私募债券等）、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）、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，权证占基金资产净值的比例为0%-3%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府

债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

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，有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。

本基金业绩比较基准为：中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。

#### 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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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〈年度和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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2021年6月30日的财务状况以及2021年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与2020年年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 印花税

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

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

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

#### 6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本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。对本基金在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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

#### 6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

#### 6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	105,254.41
定期存款	-

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	-
合计	105,254.41

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,255,882.04	2,227,764.40	-28,117.64	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	11,006,730.04	10,995,969.90	-10,760.14
	银行间市场	-	-	-
	合计	11,006,730.04	10,995,969.90	-10,760.14
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	13,262,612.08	13,223,734.30	-38,877.78	

#### 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 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	45.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	65.07
应收债券利息	78,422.98
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	2.25
合计	78,536.02

注：此处其他列示的是应收结算保证金利息。

**6.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	7,948.22
银行间市场应付交易费用	324.95
合计	8,273.17

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	240.95	
应付证券出借违约金	-	
预提费用-审计费	12,396.69	
合计	12,637.64	

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
	上年度末	24,832,757.27
本期申购	73,954,992.92	73,954,992.92
本期赎回（以“-”号填列）	-88,114,845.57	-88,114,845.57
本期末	10,672,904.62	10,672,904.62

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,799,920.60	-1,041,874.29	1,758,046.31
本期利润	1,163,908.06	-1,008,003.76	155,904.30
本期基金份额交易产生的变动数	-2,069,666.36	879,934.88	-1,189,731.48
其中：基金申购款	13,449,065.10	-7,873,975.42	5,575,089.68
基金赎回款	-15,518,731.46	8,753,910.30	-6,764,821.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,894,162.30	-1,169,943.17	724,219.13

#### 6.4.7.11 存款利息收入



单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	20,371.92
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	692.79
其他	113.72
合计	21,178.43

## 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	9,254,945.79
减：卖出股票成本总额	8,407,953.57
买卖股票差价收入	846,992.22

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	262,416.62
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	262,416.62

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	79,497,918.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	78,536,494.40
减：应收利息总额	699,007.60
买卖债券差价收入	262,416.62

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

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

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	7,619.25
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	7,619.25

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-1,008,003.76
——股票投资	-819,964.37
——债券投资	-188,039.39
——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	-1,008,003.76

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	60,874.33
转换费收入	74.73
合计	60,949.06

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	26,584.30
银行间市场交易费用	350.00
合计	26,934.30

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	12,396.69
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,142.54
账户维护费	17,700.00
其他	600.00
合计	33,839.23

**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，本基金无其他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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	75,936.08	1,247,389.29
其中：支付销售机构的客户维护费	28,443.18	801,874.26

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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付指令，经基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	21,696.10	356,396.91

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

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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付指令，经基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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

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

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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
交通银行股份有限公司	105,254.41	20,371.92	389,554.58	74,757.29

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。另外，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2021年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2020年6月30日：同）。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	认购新发证券	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	-

#### 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2021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证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币2,200,000.00元，于2021年7月1日、2021年7月2日、2021年7月5日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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



均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

##### 6.4.13.3.2 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 2021年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	105,254.41	-	-	-	-	-	105,254.41
结算备付金	160,719.08	-	-	-	-	-	160,719.08
存出保证金	5,409.80	-	-	-	-	-	5,409.80
交易性金融资产	1,473,161.00	-	5,475,098.80	438,321.30	3,609,388.80	2,227,764.40	13,223,734.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	271,315.12	271,315.12
应收利息	-	-	-	-	-	78,536.02	78,536.02
资产总计	1,744,544.29	-	5,475,098.80	438,321.30	3,609,388.80	2,577,615.54	13,844,968.73
负债							
卖出回购金融资产款	2,200,000.00	-	-	-	-	-	2,200,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	109,147.25	109,147.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	107,775.77	107,775.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,389.20	7,389.20
应付托管费	-	-	-	-	-	2,111.20	2,111.20
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,273.17	8,273.17
应交税费	-	-	-	-	-	118.95	118.95
应付利息	-	-	-	-	-	391.80	391.80
其他负债	-	-	-	-	-	12,637.64	12,637.64
负债总计	2,200,000.00	-	-	-	-	247,844.98	2,447,844.98

利率敏感度缺口	-455,455.71	-	5,475,098.80	438,321.30	3,609,388.80	2,329,770.56	11,397,123.75
上年度末 2020年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	100,610.74	-	-	-	-	-	100,610.74
结算备付金	263,157.76	-	-	-	-	-	263,157.76
存出保证金	33,037.39	-	-	-	-	-	33,037.39
交易性金融资产	454,880.30	832,273.70	7,320,653.70	12,739,668.70	2,876,447.60	3,962,987.34	28,186,911.34
应收证券清算款	-	-	-	-	-	77,256.08	77,256.08
应收利息	-	-	-	-	-	183,877.32	183,877.32
应收申购款	-	-	-	-	-	1,049.16	1,049.16
资产总计	851,686.19	832,273.70	7,320,653.70	12,739,668.70	2,876,447.60	4,225,169.90	28,845,899.79
负债							
卖出回购金融资产款	2,000,000.00	-	-	-	-	-	2,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	61,543.27	61,543.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,035.78	17,035.78
应付托管费	-	-	-	-	-	4,867.36	4,867.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	21,030.05	21,030.05
应交税费	-	-	-	-	-	144.85	144.85
应付利息	-	-	-	-	-	384.38	384.38
其他负债	-	-	-	-	-	150,090.52	150,090.52
负债总计	2,000,000.00	-	-	-	-	255,096.21	2,255,096.21
利率敏感度缺口	-1,148,313.81	832,273.70	7,320,653.70	12,739,668.70	2,876,447.60	3,970,073.69	26,590,803.58

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

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	利率上升25个基点	-45,601.71	-83,560.99
	利率下降25个基点	45,601.71	83,560.99

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 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 2021年06月30日		上年度末 2020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	2,227,764.40	19.55	3,962,987.34	14.90

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	10,995,969.90	96.48	24,223,924.00	91.10
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	13,223,734.30	116.03	28,186,911.34	106.00

#### 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	1,019,325.61	2,901,190.94
	业绩比较基准变动-5%	-1,019,325.61	-2,901,190.94

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 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	2,227,764.40	16.09
	其中：股票	2,227,764.40	16.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,995,969.90	79.42
	其中：债券	10,995,969.90	79.42
	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	265,973.49	1.92
8	其他各项资产	355,260.94	2.57
9	合计	13,844,968.73	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,254,636.40	11.01
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	288,780.00	2.53
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	684,348.00	6.00
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	2,227,764.40	19.55

### 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	600519	贵州茅台	200	411,340.00	3.61
2	600009	上海机场	6,000	288,780.00	2.53
3	603899	晨光文具	3,400	287,504.00	2.52
4	000001	平安银行	10,200	230,724.00	2.02
5	600036	招商银行	4,200	227,598.00	2.00
6	002142	宁波银行	5,800	226,026.00	1.98
7	300750	宁德时代	400	213,920.00	1.88
8	601012	隆基股份	2,360	209,662.40	1.84
9	601233	桐昆股份	2,900	69,861.00	0.61
10	002831	裕同科技	2,100	62,349.00	0.55

### 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	600009	上海机场	942,770.00	3.55
2	603899	晨光文具	919,005.00	3.46
3	600519	贵州茅台	858,254.00	3.23
4	600050	中国联通	697,512.00	2.62
5	002142	宁波银行	652,132.00	2.45
6	000001	平安银行	629,068.00	2.37
7	600036	招商银行	627,712.00	2.36
8	002831	裕同科技	436,999.00	1.64
9	600887	伊利股份	362,631.00	1.36
10	000333	美的集团	359,275.00	1.35
11	300750	宁德时代	292,569.00	1.10
12	601012	隆基股份	270,348.00	1.02
13	601233	桐昆股份	229,979.00	0.86
14	600489	中金黄金	132,469.00	0.50
15	002959	小熊电器	81,972.00	0.31

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	603899	晨光文具	1,118,969.00	4.21
2	600009	上海机场	1,021,156.79	3.84
3	600036	招商银行	921,755.00	3.47
4	000001	平安银行	916,026.00	3.44
5	002142	宁波银行	875,857.00	3.29
6	600519	贵州茅台	826,811.00	3.11
7	600887	伊利股份	706,795.00	2.66



8	600050	中国联通	683,800.00	2.57
9	000333	美的集团	599,260.00	2.25
10	002831	裕同科技	506,594.00	1.91
11	601318	中国平安	344,170.00	1.29
12	002959	小熊电器	205,302.00	0.77
13	601233	桐昆股份	163,325.00	0.61
14	300750	宁德时代	139,595.00	0.52
15	600489	中金黄金	122,816.00	0.46
16	601012	隆基股份	102,714.00	0.39

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	7,492,695.00
卖出股票收入（成交）总额	9,254,945.79

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

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	658,556.70	5.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,609,388.80	31.67
	其中：政策性金融债	3,609,388.80	31.67
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)	6,728,024.40	59.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	10,995,969.90	96.48
----	----	---------------	-------

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	018012	国开2003	35,680	3,609,388.80	31.67
2	132009	17中油EB	10,500	1,080,450.00	9.48
3	132008	17山高EB	4,750	496,945.00	4.36
4	019645	20国债15	4,570	458,416.70	4.02
5	123111	东财转3	3,090	452,252.40	3.97

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	5,409.80
2	应收证券清算款	271,315.12
3	应收股利	-
4	应收利息	78,536.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	355,260.94

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	------	---------------

1	110059	浦发转债	409,720.00	3.59
2	110053	苏银转债	364,080.00	3.19
3	128136	立讯转债	350,850.00	3.08
4	113605	大参转债	300,404.00	2.64
5	110062	烽火转债	250,087.00	2.19
6	110051	中天转债	241,143.00	2.12
7	128135	洽洽转债	239,820.00	2.10
8	110045	海澜转债	200,934.00	1.76
9	113043	财通转债	192,042.00	1.69
10	113013	国君转债	191,777.00	1.68
11	110075	南航转债	122,890.00	1.08
12	128113	比音转债	120,344.00	1.06
13	110061	川投转债	117,891.00	1.03
14	113025	明泰转债	112,458.00	0.99
15	113584	家悦转债	88,659.00	0.78
16	128096	奥瑞转债	85,925.00	0.75

### 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
188	56,770.77	0.00	0.00%	10,672,904.62	100.00%

## 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	0.00	0.00%

## 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年11月20日)基金份额总额	472,298,840.02
本报告期期初基金份额总额	24,832,757.27
本报告期基金总申购份额	73,954,992.92
减：本报告期基金总赎回份额	88,114,845.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,672,904.62

## § 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，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

报告期内，基金管理人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

本基金于2021年4月27日起在《天治稳健双鑫债券型证券投资基金基金合同》的“释义”、“基金份额的申购与赎回”、“基金份额持有人大会”、“基金的投资”、“基金资产估值”、“基金费用与税收”、“基金的收益与分配”、“基金的信息披露”等章节增加侧袋机制相关内容。《天治稳健双鑫债券型证券投资基金托管协议》、《天治稳健双鑫债券型证券投资基金更新的招募说明书》、《天治稳健双鑫债券型证券投资基金基金产品资料概要更新》对上述内容进行相应更新。

更新后的《基金合同》、《托管协议》、《更新的招募说明书》、《产品资料概要更新》自2021年4月27日起生效。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，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

报告期内，管理人、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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	5,694,649.00	34.00%	5,189.61	33.52%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

方正 证券	1	-	-	-	-	-
广发 证券	1	-	-	-	-	-
国海 证券	1	-	-	-	-	-
国金 证券	1	-	-	-	-	-
国联 证券	1	-	-	-	-	-
国融 证券	1	-	-	-	-	-
国泰 君安	1	-	-	-	-	-
国信 证券	1	-	-	-	-	-
华创 证券	1	-	-	-	-	-
华金 证券	1	-	-	-	-	-
华泰 证券	1	-	-	-	-	-
民生 证券	1	-	-	-	-	-
申万 宏源	1	-	-	-	-	-
西南 证券	1	-	-	-	-	-
新时 代证 券	1	-	-	-	-	-
兴业 证券	1	330,341.00	1.97%	307.69	1.99%	-

银河 证券	1	-	-	-	-	-
招商 证券	1	-	-	-	-	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-
渤海 证券	2	-	-	-	-	-
长江 证券	2	10,722,650.79	64.03%	9,985.96	64.49%	-
川财 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
海通 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 联合	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
西藏 东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
长城 证券	3	-	-	-	-	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-
德邦 证券	1	-	-	-	-	-
红塔	1	-	-	-	-	-



证券						
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-

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

## 2、基金专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

3、本基金本报告期内租用券商交易单元的变更情况：租用粤开证券上海交易单元1个，中山证券深圳交易单元1个；

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	6,318,702.20	5.52%	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1,195,777.68	1.05%	4,900,000.00	19.14%	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	106,934,377.30	93.43%	20,700,000.00	80.86%	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	天治旗下十四只基金2020年第4季度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-01-22
2	天治基金管理有限公司关于天治稳健双鑫债券型证券投资基金在直销中心开展赎回费率优惠活动的公告	中证报	2021-02-08
3	天治基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在盈米基金最低申购金额、最低赎回、转换、持有份额的公告	上证报、中证报、证券时报	2021-02-23
4	天治基金管理有限公司旗下基金增加汇成基金为代销机构、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	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-03-04
5	天治旗下十四只基金2020年年度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-03-30
6	天治旗下十四只基金2021年第1季度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-04-21
7	天治基金管理有限公司关于旗下四只基金就增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	上证报、中证报、证券时报	2021-04-27
8	天治基金管理有限公司关于天治稳健双鑫债券型证券投资基金在直销中心开展赎回	中证报	2021-05-13

	费率优惠活动的公告		
9	天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加吉林银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-05-28
10	天治基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加上海基煜基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-06-24
11	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加爱建基金为代销机构、开通基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-06-24
12	天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-06-30

## § 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
机构	1	20210202-20210204;20210219-20210221	0.00	9,277,231.40	9,277,231.40	0.00	0.00%
个人	1	20210101-20210125	6,006,000.00	0.00	6,006,000.00	0.00	0.00%
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、天治稳健双鑫债券型证券投资基金设立等相关批准文件
- 2、天治稳健双鑫债券型证券投资基金基金合同
- 3、天治稳健双鑫债券型证券投资基金招募说明书
- 4、天治稳健双鑫债券型证券投资基金托管协议
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告原稿

### 12.2 存放地点

上海市复兴西路159号。

### 12.3 查阅方式

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

天治基金管理有限公司  
二〇二一年八月二十七日