

# 天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

## 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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	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	8
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	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	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	13
§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	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51

8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
8.4 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 .....	52
§9 开放式基金份额变动 .....	52
§10 重大事件揭示 .....	53
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
§12 备查文件目录 .....	59
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	天治核心成长混合（LOF）
场内简称	天治核心LOF
基金主代码	163503
交易代码	163503
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2006年01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	613,384,396.51份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年07月30日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过将部分资产投资于品质优良、成长潜力高于平均水平的中小型上市公司股票，并将部分资产用于复制大型上市公司股票指数（富时中国A200指数）的业绩表现，在控制相对市场风险的前提下，追求中长期的资本增值。
投资策略	本基金以股票品种为主要投资标的，以"核心—卫星"策略作为股票投资的总体策略。"核心—卫星"策略是指将股票资产分为核心组合和卫星组合，核心组合通过跟踪指数进行被动投资，控制投资组合相对于市场的风险；卫星组合通过优选股票进行主动投资，追求超越市场平均水平的收益。本基金的核心组合用于跟踪大型公司股票指数（富时中国A200指数），卫星组合用于优选中小型成长公司股票。
业绩比较基准	富时中国A股自由流通全盘指数×75%+富时中国国债指数×25%

风险收益特征	本基金为具有中等风险、中高收益的混合型基金，风险收益特征介于大盘平衡型基金和小盘成长型基金之间
--------	---

### 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	姚静静	方圆
	联系电话	021-60371155	95559
	电子邮箱	yaojj@chinanature.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
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188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）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200232	200336
法定代表人		马铁刚	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街17号恒奥中心A座

## §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	10,184,756.01
本期利润	17,615,376.76
加权平均基金份额本期利润	0.0284
本期加权平均净值利润率	6.71%
本期基金份额净值增长率	6.67%
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	-33,857,579.84
期末可供分配基金份额利润	-0.0552
期末基金资产净值	280,490,385.33
期末基金份额净值	0.4573
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	130.74%

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	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差④		
过去一个月	3.60%	0.69%	-3.83%	0.51%	7.43%	0.18%
过去三个月	7.27%	0.82%	-3.32%	0.69%	10.59%	0.13%
过去六个月	6.67%	1.17%	-3.05%	0.87%	9.72%	0.30%
过去一年	-16.28%	1.13%	-9.72%	0.75%	-6.56%	0.38%
过去三年	-33.48%	1.64%	-20.79%	0.81%	-12.69%	0.83%
自基金合同生效起至今	130.74%	1.66%	237.99%	1.23%	-107.25%	0.43%

### 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

天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2006年01月20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、天治天得利货币市场基金、天治稳健双赢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、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、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		
李申	权益投资部总监兼产品开发与金融工程部总监、本基金基金经理、天治财富增长证券投资基金基金经理、天治转型升级混合型证券投资基金基金经理、天治	2023-07-27	-	10年	硕士研究生，具有基金从业资格。2014年4月至2015年9月于日发资产管理（上海）有限公司任高级研究员。2015年10月加入天治基金管理有限公司，历任产品开发与金融工程部金融工程研究员、总监助理、副总监。

	可转债增强债券型 证券投资基金基金 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《天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》、《天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）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

2024年上半年，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。国内主要指数表现偏弱，其中创业板跌幅较大。在国内经济偏弱的背景下，十年期国债利率低位震荡。具体来看，地产、消费相对低迷，基建投资增速受地方政府化债以及专项债发行偏慢影响，整体增速较弱。出口和制造业投资景气度维持相对高位，主要受益于海外需求修复和设备更新改造政策的影响，尤其是出口在补库存和低基数的背景下，年初至今持续改善。此外，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，随着两会、4月政治局会议、7月三中全会顺利召开，绘制了未来几年国内经济发展的蓝图，高质量发展和中国式现代化是未来一段时间国内经济发展的总体目标。国内经济将进入新的发展阶段，一方面通过科技创新提高生产力，另一方面通过改革挖掘经济发展潜力。对于当前经济，三中全会释放积极的稳增长信号，强调坚定不移实现全年经济社会发展目标，落实好宏观政策，积极扩大国内需求；防范化解房地产、地方政府债务、中小金融机构等重点领域风险。

投资策略方面，上半年继续执行核心-卫星策略，大小盘均衡配置，一季度在系统性风险后的超跌反弹过程中积极参与了包括TMT、电新、有色、机械、汽车、军工、化工、食品饮料等板块，特别是大盘成长股的投资机会。随后考虑到土地财政的替代效应，本基金3月份以来持续聚焦在电力及公用事业等稳定类资产，看好稳定类资产价值重估的机会，如水电、火电、核电、燃气、铁路、公路等。“十四五”陆续推进的电力体制改革成果，在今年的经营环境中开始陆续体现，但是新的矛盾也在逐步浮现，这给了市场后续存在进一步电力体制改革的想象空间；随着电力需求的进一步提升，电价有望进一步上行，伴随容量电价、辅助服务及市场化电价等以及列电力体制改革，整个电力及公用事业板块有望迎来进一步的催化。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末天治核心成长混合（LOF）基金份额净值为0.4573元，本报告期内，基金份额净值增长率为6.67%，同期业绩比较基准收益率为-3.05%。

#### 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年下半年，预计总量经济向上弹性有限，但政策重点提及的新质生产力相关领域预计维持较高的景气度。同时，预计下半年出口仍然是景气度相对较好的方向，但贸易壁垒下我国出口结构已发生变化，出口的拉动核心可能由发达经济体转向新兴经济体，东盟、俄罗斯和其他亚非拉经济体正构成中国出口的“新”动能。短期海外经济复苏面临一定曲折但仍有韧性，重点关注美国大选贸易摩擦对出口的扰动。

海外方面，全球央行陆续开启降息周期，全球制造业PMI预计维持上行趋势。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。

行业和风格方面，上半年煤炭、电力、石化和交运等传统红利板块表现较好，预计这些板块下半年仍具备较好的配置价值，而随着这类“稳定资产”的估值抬升，有利于抬高整体A股市场的估值水平，下半年随着国内经济预期改善，预计传统红利板块行情将逐步扩散至各行业有成长性的核心红利资产，主要体现在业绩稳健、有一定的成长性和稳定分红的各行业龙头标的。同时，当前受益于政策导向的前沿科技行业，虽然短期依然依赖政策补贴等方式去实现快速发展，但其作为新质生产力的重要导向，预计在当前市场风格下，也会有波段性的机会，重点关注人工智能、低空经济、卫星互联网、机器人和智能驾驶等领域。

#### 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

2024上半年，基金托管人在天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）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

2024上半年，天治基金管理有限公司在天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）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

2024上半年，由天治基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### §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：天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

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	17,320,402.46	16,377,066.94
结算备付金		947,864.56	2,026,530.72
存出保证金		249,685.75	323,994.26

交易性金融资产	6.4.7.2	264,092,576.33	251,400,099.81
其中：股票投资		264,092,576.33	251,400,099.81
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		3,279,455.85	3,112,444.67
应收股利		-	-
应收申购款		599.10	2,776.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		285,890,584.05	273,242,912.53
<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		3,251,369.52	2,549,845.01
应付赎回款		91,860.23	2,383.49
应付管理人报酬		271,892.78	274,418.70
应付托管费		45,315.44	45,736.44
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	1,739,760.75	2,137,291.64
负债合计		5,400,198.72	5,009,675.28
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	314,347,965.17	320,625,994.04
未分配利润	6.4.7.8	-33,857,579.84	-52,392,756.79
净资产合计		280,490,385.33	268,233,237.25
负债和净资产总计		285,890,584.05	273,242,912.53

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额净值0.4573元，基金份额总额613,384,396.51份。

## 6.2 利润表

会计主体：天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

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>		19,542,162.79	31,326,048.80
1.利息收入		103,490.77	95,856.41
其中：存款利息收入	6.4.7.9	90,580.10	95,856.41
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		12,910.67	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		12,003,193.73	1,311,887.21
其中：股票投资收益	6.4.7.10	10,483,454.10	-61,563.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	5,018.44

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	1,519,739.63	1,368,432.26
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	7,430,620.75	29,906,531.42
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	4,857.54	11,773.76
<b>减：二、营业总支出</b>		1,926,786.03	2,514,585.38
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,563,245.82	1,996,946.92
2.托管费	6.4.10.2.2	260,540.97	416,030.60
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	102,999.24	101,607.86
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		17,615,376.76	28,811,463.42
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		17,615,376.76	28,811,463.42
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		17,615,376.76	28,811,463.42



**6.3 净资产变动表**

会计主体：天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

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	320,625,994.04	-52,392,756.79	268,233,237.25
二、本期期初净资产	320,625,994.04	-52,392,756.79	268,233,237.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,278,028.87	18,535,176.95	12,257,148.08
（一）、综合收益总额	-	17,615,376.76	17,615,376.76
（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）	-6,278,028.87	919,800.19	-5,358,228.68
其中：1.基金申购款	3,432,022.55	-706,915.46	2,725,107.09
2.基金赎回款	-9,710,051.42	1,626,715.65	-8,083,335.77
（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	314,347,965.17	-33,857,579.84	280,490,385.33
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	320,911,059.83	-7,331,504.60	313,579,555.23
二、本期期初净资产	320,911,059.83	-7,331,504.60	313,579,555.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,271,101.40	28,146,211.53	23,875,110.13
（一）、综合收益总额	-	28,811,463.42	28,811,463.42
（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）	-4,271,101.40	-665,251.89	-4,936,353.29
其中：1.基金申购款	10,719,668.50	436,875.71	11,156,544.21
2.基金赎回款	-14,990,769.90	-1,102,127.60	-16,092,897.50
（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	316,639,958.43	20,814,706.93	337,454,665.36

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

天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）（原名天治核心成长股票型证券投资基金（LOF））（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2005]134号文《关于同意天治核心成长股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人天治基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2006年1月20日正式生效，首次设立募集规模为313,493,538.86份基金份额。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天治基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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，经与基金托管人交通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核心成长混合型证券投资基金（LOF）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的各种股票、存托凭证、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金以股票品种为主要投资标的，以“核心—卫星”策略作为股票投资的总体策略。在一般情况下，本基金的资产类别配置的范围为：股票投资比例为基金净资产的60%-95%，其中，核心组合的投资比例为股票资产净值的55%-65%，卫星组合的投资比例为股票资产净值的35%-45%；债券投资比例为基金净资产的0%—40%，现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具不低于基金净资产的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：富时中国A股自由流通全盘指数×75%+富时中国国债指数×25%。

2007年10月15日（拆分日），本基金管理人天治基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分后基金份额面值为人民币0.5125元。

#### 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，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、营业税的单位和个体，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	17,320,402.46
等于：本金	17,318,889.10
加：应计利息	1,513.36
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	17,320,402.46

#### 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	252,689,461.01	-	264,092,576.33	11,403,115.32
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	252,689,461.01	-	264,092,576.33	11,403,115.32

#### 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	21.91
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,590,273.06
其中：交易所市场	1,590,273.06
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	22,376.90
预提费用-信息披露费	59,672.34
其他应付	67,416.54
合计	1,739,760.75

#### 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	625,634,715.29	320,625,994.04
本期申购	6,696,847.22	3,432,022.55
本期赎回（以“-”号填列）	-18,947,166.00	-9,710,051.42
本期末	613,384,396.51	314,347,965.17

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	129,088,140.11	-181,480,896.90	-52,392,756.79
本期期初	129,088,140.11	-181,480,896.90	-52,392,756.79
本期利润	10,184,756.01	7,430,620.75	17,615,376.76
本期基金份额交易产生的变动数	-2,576,597.97	3,496,398.16	919,800.19
其中：基金申购款	1,319,606.85	-2,026,522.31	-706,915.46
基金赎回款	-3,896,204.82	5,522,920.47	1,626,715.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	136,696,298.15	-170,553,877.99	-33,857,579.84

#### 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	70,266.05
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	17,670.47
其他	2,643.58
合计	90,580.10

#### 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	1,433,865,354.07
减：卖出股票成本总额	1,419,827,722.98
减：交易费用	3,554,176.99
买卖股票差价收入	10,483,454.10

#### 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	1,519,739.63
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	1,519,739.63

**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	7,430,620.75
——股票投资	7,430,620.75
——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	7,430,620.75

**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	4,857.54

合计	4,857.54
----	----------

#### 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	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	2,350.00
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	102,999.24

#### 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、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 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	1,563,245.82	1,996,946.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	351,386.43	389,812.67
应支付基金管理人的净管理费	1,211,859.39	1,607,134.25

注：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	260,540.97	416,030.60

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，由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
交通银行股份有限公司	17,320,402.46	70,266.05	20,166,283.05	73,602.81

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，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2024年6月30日的余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2023年6月30日：同）。

**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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
6032	键邦	2024	1个月内	新股	18.65	18.65	1,158	21,59	21,59	-

85	股份	-06-28	(含)	限售				6.70	6.70	
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内(含)	新股限售	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	1-6个月(含)	新股限售	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301565	中仑新材	2024-06-13	1-6个月(含)	新股限售	11.88	18.98	671	7,971.48	12,735.58	-
301566	达利凯普	2023-12-22	1-6个月(含)	新股限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
688709	成都华微	2024-01-31	1-6个月(含)	新股限售	15.69	18.79	481	7,546.89	9,037.99	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	1-6个月(含)	新股限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	1-6个月(含)	新股限售	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
688695	中创股份	2024-03-06	1-6个月(含)	新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	1-6个月(含)	新股限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	1-6个月(含)	新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	1-6个月(含)	新股限售	26.00	37.49	144	3,744.00	5,398.56	-
301502	华阳智能	2024-01-2	1-6个月(含)	新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-



		6								
603344	星德胜	2024-03-13	1-6个月（含）	新股限售	19.18	22.66	153	2,934.54	3,466.98	-
603082	北自科技	2024-01-23	1-6个月（含）	新股限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603375	盛景微	2024-01-17	1-6个月（含）	新股限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	1-6个月（含）	新股限售	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
603312	西典新能	2024-01-04	1-6个月（含）	新股限售	29.02	25.36	104	3,018.08	2,637.44	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1-6个月（含）	新股限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	1-6个月（含）	新股限售	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

#### 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 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	17,320,402.46	-	-	-	-	-	17,320,402.46
结算备付金	947,864.56	-	-	-	-	-	947,864.56
存出保证金	249,685.75	-	-	-	-	-	249,685.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	264,092,576.33	264,092,576.33
应收清算款	-	-	-	-	-	3,279,455.85	3,279,455.85

应收申购款	-	-	-	-	-	599.10	599.10
资产总计	18,517,952.77	-	-	-	-	267,372,631.28	285,890,584.05
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	3,251,369.52	3,251,369.52
应付赎回款	-	-	-	-	-	91,860.23	91,860.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	271,892.78	271,892.78
应付托管费	-	-	-	-	-	45,315.44	45,315.44
其他负债	-	-	-	-	-	1,739,760.75	1,739,760.75
负债总计	-	-	-	-	-	5,400,198.72	5,400,198.72
利率敏感度缺口	18,517,952.77	-	-	-	-	261,972,432.56	280,490,385.33
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							
货币资金	16,377,066.94	-	-	-	-	-	16,377,066.94
结算备付金	2,026,530.72	-	-	-	-	-	2,026,530.72
存出保证金	323,994.26	-	-	-	-	-	323,994.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	251,400,099.81	251,400,099.81
应收清算款	-	-	-	-	-	3,112,444.67	3,112,444.67
应收申购款	-	-	-	-	-	2,776.13	2,776.13
资产总计	18,727,591.92	-	-	-	-	254,515,320.61	273,242,912.53

负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	2,549,845.01	2,549,845.01
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,383.49	2,383.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	274,418.70	274,418.70
应付托管费	-	-	-	-	-	45,736.44	45,736.44
其他负债	-	-	-	-	-	2,137,291.64	2,137,291.64
负债总计	-	-	-	-	-	5,009,675.28	5,009,675.28
利率敏感度缺口	18,727,591.92	-	-	-	-	249,505,645.33	268,233,237.25

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

本基金本期末和上年度末均未持有债券投资，故无利率风险。

#### 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 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	264,092,576.33	94.15	251,400,099.81	93.72
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	264,092,576.33	94.15	251,400,099.81	93.72

#### 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%	13,150,608.81	21,592,907.29
	业绩比较基准变动-5%	-13,150,608.81	-21,592,907.29

#### 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	263,944,143.10	250,456,927.74
第二层次	45,611.11	10,869.72
第三层次	102,822.12	932,302.35
合计	264,092,576.33	251,400,099.81

##### 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	264,092,576.33	92.38
	其中：股票	264,092,576.33	92.38
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	18,268,267.02	6.39
8	其他各项资产	3,529,740.70	1.23
9	合计	285,890,584.05	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	6,117,249.49	2.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	207,445,308.06	73.96
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	34,013,750.48	12.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,868.30	0.00
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	16,510,400.00	5.89
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	264,092,576.33	94.15

### 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	601985	中国核电	2,149,991	22,918,904.06	8.17
2	003816	中国广核	4,000,000	18,520,000.00	6.60
3	600795	国电电力	3,000,000	17,970,000.00	6.41
4	001965	招商公路	1,300,068	15,418,806.48	5.50
5	600886	国投电力	840,000	15,321,600.00	5.46
6	600900	长江电力	517,000	14,951,640.00	5.33
7	000598	兴蓉环境	1,130,000	8,497,600.00	3.03
8	600483	福能股份	720,000	8,395,200.00	2.99
9	600323	瀚蓝环境	400,000	8,360,000.00	2.98
10	600027	华电国际	1,200,000	8,328,000.00	2.97
11	000883	湖北能源	1,380,000	8,293,800.00	2.96
12	601827	三峰环境	960,000	8,150,400.00	2.91

13	600461	洪城环境	700,000	8,106,000.00	2.89
14	001286	陕西能源	660,000	7,609,800.00	2.71
15	600011	华能国际	750,000	7,215,000.00	2.57
16	601006	大秦铁路	1,000,000	7,160,000.00	2.55
17	000543	皖能电力	800,000	7,080,000.00	2.52
18	300750	宁德时代	33,000	5,940,990.00	2.12
19	000600	建投能源	900,000	5,670,000.00	2.02
20	600025	华能水电	500,000	5,390,000.00	1.92
21	601816	京沪高铁	1,000,000	5,370,000.00	1.91
22	002039	黔源电力	300,000	5,280,000.00	1.88
23	600023	浙能电力	740,000	5,261,400.00	1.88
24	600578	京能电力	1,500,000	4,860,000.00	1.73
25	600674	川投能源	250,000	4,687,500.00	1.67
26	002608	江苏国信	600,000	4,650,000.00	1.66
27	000539	粤电力A	900,000	4,572,000.00	1.63
28	601991	大唐发电	1,500,000	4,515,000.00	1.61
29	600642	申能股份	500,000	4,415,000.00	1.57
30	000429	粤高速A	400,000	4,164,000.00	1.48
31	000690	宝新能源	600,000	3,060,000.00	1.09
32	002120	韵达股份	245,600	1,900,944.00	0.68
33	605368	蓝天燃气	137,600	1,876,864.00	0.67
34	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
35	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
36	301526	国际复材	4,703	15,660.99	0.01
37	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
38	301565	中仑新材	671	12,735.58	0.00
39	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
40	688709	成都华微	481	9,037.99	0.00
41	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
42	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
43	688720	艾森股份	165	6,689.10	0.00

44	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
45	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
46	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
47	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
48	603341	龙旗科技	144	5,398.56	0.00
49	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
50	603344	星德胜	153	3,466.98	0.00
51	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
52	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
53	603004	鼎龙科技	163	2,762.85	0.00
54	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
55	603312	西典新能	104	2,637.44	0.00
56	603231	索宝蛋白	146	2,487.84	0.00

#### 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	300750	宁德时代	50,913,236.00	18.98
2	601985	中国核电	41,388,344.96	15.43
3	600900	长江电力	34,043,135.00	12.69
4	600795	国电电力	31,171,445.00	11.62
5	600886	国投电力	30,451,243.00	11.35
6	600519	贵州茅台	30,047,731.00	11.20
7	601658	邮储银行	24,875,895.00	9.27
8	000858	五粮液	24,209,274.00	9.03
9	001965	招商公路	22,907,913.92	8.54
10	003816	中国广核	22,235,272.00	8.29
11	600036	招商银行	21,770,412.00	8.12

12	000002	万科A	19,805,906.56	7.38
13	002594	比亚迪	17,165,787.00	6.40
14	002475	立讯精密	16,735,988.95	6.24
15	600483	福能股份	16,683,622.62	6.22
16	000568	泸州老窖	16,288,839.00	6.07
17	600048	保利发展	14,483,957.00	5.40
18	001979	招商蛇口	14,108,893.73	5.26
19	600050	中国联通	13,974,399.00	5.21
20	688111	金山办公	13,943,640.48	5.20
21	000600	建投能源	13,562,628.00	5.06
22	002352	顺丰控股	13,054,869.00	4.87
23	603259	药明康德	12,672,205.71	4.72
24	600702	舍得酒业	12,655,380.00	4.72
25	000333	美的集团	12,627,198.00	4.71
26	002608	江苏国信	12,564,982.00	4.68
27	601816	京沪高铁	12,019,100.00	4.48
28	600027	华电国际	11,959,505.00	4.46
29	300760	迈瑞医疗	11,889,430.00	4.43
30	600019	宝钢股份	11,861,562.00	4.42
31	600461	洪城环境	11,839,917.51	4.41
32	601398	工商银行	11,627,000.00	4.33
33	002039	黔源电力	11,380,994.80	4.24
34	002241	歌尔股份	11,312,618.36	4.22
35	000895	双汇发展	10,278,749.00	3.83
36	000543	皖能电力	9,815,473.00	3.66
37	002371	北方华创	9,628,498.00	3.59
38	600578	京能电力	9,575,762.00	3.57
39	600023	浙能电力	9,498,246.19	3.54
40	601088	中国神华	9,403,521.00	3.51
41	600809	山西汾酒	9,373,290.00	3.49
42	600011	华能国际	9,327,138.00	3.48

43	600674	川投能源	9,244,289.26	3.45
44	601006	大秦铁路	9,238,000.00	3.44
45	002027	分众传媒	9,002,140.00	3.36
46	600887	伊利股份	9,001,836.00	3.36
47	000338	潍柴动力	8,825,769.00	3.29
48	000539	粤电力A	8,760,478.00	3.27
49	600025	华能水电	8,734,419.00	3.26
50	600642	申能股份	8,581,143.94	3.20
51	600938	中国海油	8,570,016.00	3.19
52	600377	宁沪高速	8,432,621.00	3.14
53	605368	蓝天燃气	8,275,663.00	3.09
54	000651	格力电器	8,265,491.00	3.08
55	000883	湖北能源	8,212,231.04	3.06
56	002271	东方雨虹	8,168,078.00	3.05
57	600323	瀚蓝环境	8,129,662.00	3.03
58	600905	三峡能源	8,125,008.00	3.03
59	601857	中国石油	8,054,453.00	3.00
60	600989	宝丰能源	8,007,118.00	2.99
61	600309	万华化学	7,990,999.00	2.98
62	002384	东山精密	7,978,470.00	2.97
63	000598	兴蓉环境	7,919,331.00	2.95
64	601827	三峰环境	7,862,969.00	2.93
65	000429	粤高速A	7,861,874.00	2.93
66	600941	中国移动	7,700,813.00	2.87
67	601288	农业银行	7,496,000.00	2.79
68	601939	建设银行	7,489,178.00	2.79
69	601988	中国银行	7,474,878.00	2.79
70	001286	陕西能源	7,382,895.00	2.75
71	601728	中国电信	7,321,000.00	2.73
72	603501	韦尔股份	7,270,339.00	2.71
73	000977	浪潮信息	7,251,929.80	2.70

74	002415	海康威视	6,938,485.00	2.59
75	600282	南钢股份	6,931,701.00	2.58
76	600028	中国石化	6,902,299.00	2.57
77	300896	爱美客	6,797,528.06	2.53
78	601139	深圳燃气	6,716,844.00	2.50
79	601991	大唐发电	6,671,131.00	2.49
80	000725	京东方A	6,623,000.00	2.47
81	601818	光大银行	6,546,400.00	2.44
82	002517	恺英网络	6,454,256.00	2.41
83	600000	浦发银行	5,802,893.00	2.16
84	600919	江苏银行	5,725,695.00	2.13
85	600820	隧道股份	5,510,371.00	2.05
86	600376	首开股份	5,506,365.29	2.05
87	600585	海螺水泥	5,423,153.00	2.02
88	300413	芒果超媒	5,392,124.00	2.01
89	601336	新华保险	5,390,538.00	2.01
90	300122	智飞生物	5,375,964.00	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	300750	宁德时代	44,240,326.84	16.49
2	600519	贵州茅台	33,073,365.68	12.33
3	000002	万科A	30,708,014.00	11.45
4	600036	招商银行	25,229,043.44	9.41
5	000858	五粮液	25,172,563.00	9.38
6	601658	邮储银行	24,860,348.00	9.27

7	600048	保利发展	22,190,142.66	8.27
8	601985	中国核电	22,139,487.00	8.25
9	600900	长江电力	21,035,933.41	7.84
10	688111	金山办公	19,430,258.39	7.24
11	002594	比亚迪	18,931,138.00	7.06
12	001979	招商蛇口	17,885,033.00	6.67
13	002352	顺丰控股	17,640,274.00	6.58
14	600886	国投电力	17,477,069.94	6.52
15	002475	立讯精密	17,024,557.00	6.35
16	000568	泸州老窖	17,003,386.00	6.34
17	600795	国电电力	15,803,479.98	5.89
18	600050	中国联通	13,967,000.00	5.21
19	600702	舍得酒业	12,793,293.00	4.77
20	002371	北方华创	12,769,484.79	4.76
21	000333	美的集团	12,716,733.00	4.74
22	002384	东山精密	12,610,634.00	4.70
23	002027	分众传媒	12,547,348.00	4.68
24	600585	海螺水泥	12,126,093.00	4.52
25	601966	玲珑轮胎	12,048,048.20	4.49
26	600809	山西汾酒	12,024,410.48	4.48
27	601398	工商银行	11,934,800.00	4.45
28	600019	宝钢股份	11,783,355.00	4.39
29	300760	迈瑞医疗	11,655,260.00	4.35
30	600887	伊利股份	11,541,007.95	4.30
31	002271	东方雨虹	10,929,020.00	4.07
32	603259	药明康德	10,514,820.40	3.92
33	002241	歌尔股份	10,501,700.00	3.92
34	000895	双汇发展	10,219,954.00	3.81
35	002244	滨江集团	9,924,619.52	3.70
36	601088	中国神华	9,783,614.00	3.65
37	601601	中国太保	9,371,514.00	3.49

38	600483	福能股份	9,347,280.10	3.48
39	601857	中国石油	9,253,112.00	3.45
40	600325	华发股份	9,085,136.00	3.39
41	601336	新华保险	9,082,375.00	3.39
42	000338	潍柴动力	8,748,613.00	3.26
43	600030	中信证券	8,396,963.00	3.13
44	600999	招商证券	8,377,807.00	3.12
45	001965	招商公路	8,375,055.00	3.12
46	600377	宁沪高速	8,302,675.00	3.10
47	600938	中国海油	8,247,272.00	3.07
48	600309	万华化学	8,144,767.00	3.04
49	000651	格力电器	8,085,719.00	3.01
50	600989	宝丰能源	7,956,561.00	2.97
51	601288	农业银行	7,836,000.00	2.92
52	600905	三峡能源	7,807,000.00	2.91
53	002372	伟星新材	7,780,124.00	2.90
54	601728	中国电信	7,768,000.00	2.90
55	000425	徐工机械	7,762,331.00	2.89
56	000600	建投能源	7,664,393.00	2.86
57	000786	北新建材	7,615,868.00	2.84
58	601988	中国银行	7,594,000.00	2.83
59	002608	江苏国信	7,582,859.00	2.83
60	600941	中国移动	7,499,561.00	2.80
61	000977	浪潮信息	7,437,486.00	2.77
62	603816	顾家家居	7,436,227.60	2.77
63	601939	建设银行	7,434,000.00	2.77
64	002415	海康威视	7,407,234.26	2.76
65	600282	南钢股份	7,273,520.00	2.71
66	300896	爱美客	7,231,992.00	2.70
67	603501	韦尔股份	7,223,963.25	2.69
68	600115	中国东航	7,143,400.00	2.66



69	002039	黔源电力	7,067,225.41	2.63
70	600028	中国石化	7,028,436.00	2.62
71	601816	京沪高铁	6,906,531.00	2.57
72	000725	京东方A	6,864,200.00	2.56
73	600926	杭州银行	6,804,734.00	2.54
74	601689	拓普集团	6,642,338.00	2.48
75	688981	中芯国际	6,639,248.30	2.48
76	601139	深圳燃气	6,610,892.00	2.46
77	002517	恺英网络	6,508,403.00	2.43
78	688630	芯碁微装	6,400,246.49	2.39
79	605368	蓝天燃气	6,368,376.96	2.37
80	600000	浦发银行	6,347,897.00	2.37
81	600820	隧道股份	6,244,402.00	2.33
82	601818	光大银行	6,173,285.00	2.30
83	002920	德赛西威	6,085,033.42	2.27
84	600919	江苏银行	5,947,500.00	2.22
85	601111	中国国航	5,837,710.00	2.18
86	600761	安徽合力	5,724,258.00	2.13
87	002984	森麒麟	5,699,202.06	2.12
88	688012	中微公司	5,647,341.55	2.11
89	003816	中国广核	5,633,500.00	2.10
90	600674	川投能源	5,613,984.00	2.09
91	603993	洛阳钼业	5,528,800.00	2.06
92	300122	智飞生物	5,447,189.00	2.03
93	601600	中国铝业	5,404,830.00	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	1,425,089,578.75
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,433,865,354.07
--------------	------------------

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	249,685.75
2	应收清算款	3,279,455.85
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	599.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,529,740.70

**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
33,903	18,092.33	1,277,815.96	0.21%	612,106,580.55	99.79%

**8.2 期末上市基金前十名持有人**

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	陈瑞荣	2,419,757.00	0.39%
2	陈明杰	2,383,939.00	0.39%
3	陈红梅	519,879.00	0.08%
4	曹建敏	519,401.00	0.08%
5	杨胜利	480,000.00	0.08%
6	黄国建	421,415.00	0.07%
7	罗雪娟	412,900.00	0.07%
8	聂玉洁	404,900.00	0.07%
9	赵茂金	400,675.00	0.07%
10	辜子心	393,424.00	0.06%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	12,073.03	0.00%

### 8.4 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	0~10
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(2006年01月20日)基金份额总额	313,493,538.86
本报告期期初基金份额总额	625,634,715.29
本报告期基金总申购份额	6,696,847.22
减：本报告期基金总赎回份额	18,947,166.00
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期期末基金份额总额

613,384,396.51

**§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	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	

	量					
爱建 证券	1	421,603,062.92	14.75%	398,794.88	15.03%	-
诚通 证券 (原名 新时代 证券)	2	-	-	-	-	-
长城 证券	1	-	-	-	-	-
德邦 证券	1	68,882,525.72	2.41%	65,155.57	2.46%	-
东北 证券	1	75,831,451.50	2.65%	70,970.53	2.67%	-
东方 证券	1	-	-	-	-	-
东吴 证券	1	836,638,519.49	29.27%	791,378.07	29.82%	-
东兴 证券	1	124,994,707.03	4.37%	116,982.29	4.41%	-
国海 证券	1	-	-	-	-	-
国金 证券	1	-	-	-	-	-
国联 证券	1	-	-	-	-	-
国融 证券	1	-	-	-	-	-
国盛 证券	1	-	-	-	-	-
国泰 君安	1	-	-	-	-	-

证券						
国信 证券	1	-	-	-	-	-
海通 证券	1	-	-	-	-	-
恒泰 证券	1	-	-	-	-	-
华创 证券	1	-	-	-	-	-
华金 证券	1	-	-	-	-	-
华泰 证券	1	420,736,297.83	14.72%	393,768.82	14.84%	-
开源 证券	1	-	-	-	-	-
联储 证券	1	75,787,751.72	2.65%	33,793.95	1.27%	-
民生 证券	1	-	-	-	-	-
山西 证券	1	156,236,239.72	5.47%	146,221.98	5.51%	-
申万 宏源 证券	2	278,911,978.36	9.76%	263,819.49	9.94%	-
首创 证券	1	-	-	-	-	-
西南 证券	1	-	-	-	-	-
兴业 证券	1	-	-	-	-	-
银河 证券	1	-	-	-	-	-
英大	1	-	-	-	-	-

证券						
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中山证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	46,867,686.77	1.64%	43,863.80	1.65%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	115,716,572.08	4.05%	108,298.95	4.08%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	236,065,384.55	8.26%	220,933.80	8.32%	-

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、上述交易单元为本基金本报告期内全部在租用的交易单元。

### 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
爱建证券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚通证券(原名新时代证券)	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	88,000.00 0.00	100.00%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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
2	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

3	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
4	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
5	天治旗下十五只基金 2023年年度报告汇总	中国证监会指定媒介	2024-03-27
6	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
7	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)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**  
无。

**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.中国证监会批准天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）募集的文件
- 2.《天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3.《天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4.《天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照

## 6.报告期内天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）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-上海市徐汇区云锦路701号西岸智塔东塔楼19层。

### 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