

# 天治鑫利纯债债券型证券投资基金（原天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型）2019 年半年度报告

2019 年 6 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：2019 年 8 月 23 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 20 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。

天治鑫利纯债债券型证券投资基金的报告期自 2019 年 3 月 7 日起至 6 月 30 日止；原天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 6 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况（转型后）                         | 6         |
| 2.1 基金基本情况（转型前）                         | 6         |
| 2.2 基金产品说明（转型后）                         | 6         |
| 2.2 基金产品说明（转型前）                         | 7         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式                              | 8         |
| 2.5 其他相关资料                              | 8         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | <b>9</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 9         |
| 3.2 基金净值表现（转型后）                         | 10        |
| 3.2 基金净值表现（转型前）                         | 12        |
| 3.3 其他指标                                | 14        |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>15</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 15        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 16        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 16        |
| 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             | 17        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 18        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 18        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 18        |
| 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       | 19        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>20</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 20        |
| 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 | 20        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 20        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）</b>          | <b>21</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 21        |
| 6.2 利润表                                 | 22        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 23        |
| 6.4 报表附注                                | 24        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b>          | <b>41</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 41        |
| 6.2 利润表                                 | 42        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 43        |
| 6.4 报表附注                                | 44        |
| <b>§7 投资组合报告（转型后）</b>                   | <b>63</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 63        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 63        |
| 7.3 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 63        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 64        |
| 7.5 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 .....    | 64        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细 .....  | 64        |
| 7.7 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 ..... | 64        |
| 7.8 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 .....    | 64        |
| 7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....              | 65        |
| 7.10 投资组合报告附注 .....                         | 65        |
| <b>§7 投资组合报告（转型前） .....</b>                 | <b>67</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 67        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 67        |
| 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 .....     | 67        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 67        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 68        |
| 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 .....    | 68        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细 .....  | 68        |
| 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 ..... | 68        |
| 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 .....    | 68        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 69        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 69        |
| <b>§8 基金份额持有人信息（转型后） .....</b>              | <b>71</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 71        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 71        |
| 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的情况 .....     | 71        |
| <b>§8 基金份额持有人信息（转型前） .....</b>              | <b>73</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 73        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 73        |
| 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的情况 .....     | 73        |
| <b>§9 开放式基金份额变动(转型后) .....</b>              | <b>75</b> |
| <b>§9 开放式基金份额变动(转型前) .....</b>              | <b>76</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>77</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 77        |
| 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 .....      | 77        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 77        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 77        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 78        |
| 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 .....         | 78        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后） .....           | 78        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前） .....           | 81        |
| 10.9 其他重大事件（转型后） .....                      | 84        |
| 10.9 其他重大事件（转型前） .....                      | 84        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>86</b> |
| 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 .....    | 86        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 86        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                     | <b>87</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 87        |

|                |    |
|----------------|----|
| 12.2 存放地点..... | 87 |
| 12.3 查阅方式..... | 87 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

|                 |                 |             |
|-----------------|-----------------|-------------|
| 基金名称            | 天治鑫利纯债债券型证券投资基金 |             |
| 基金简称            | 天治鑫利纯债          |             |
| 基金主代码           | 003123          |             |
| 基金运作方式          | 契约型开放式          |             |
| 基金合同生效日         | 2019 年 3 月 7 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      | 6,957,640.57 份  |             |
| 基金合同存续期         | 不定期             |             |
| 下属分级基金的基金简称     | 天治鑫利纯债 A        | 天治鑫利纯债 C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 003123          | 003124      |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 6,944,456.26 份  | 13,184.31 份 |

### 2.1 基金基本情况（转型前）

|                 |                     |             |
|-----------------|---------------------|-------------|
| 基金名称            | 天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金 |             |
| 基金简称            | 天治鑫利半年定期开放          |             |
| 基金主代码           | 003123              |             |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |             |
| 基金合同生效日         | 2016 年 12 月 7 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      | 10,120,014.16 份     |             |
| 下属分级基金的基金简称     | 天治鑫利 A              | 天治鑫利 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 003123              | 003124      |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 10,053,620.54 份     | 66,393.62 份 |

### 2.2 基金产品说明（转型后）

|        |                                                                                                                                                                       |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在严格控制风险的前提下追求基金资产长期稳健增值，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。                                                                                                                    |
| 投资策略   | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势，对宏观经济运行趋势、财政以及货币政策变化趋势作出分析和判断，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，确定本基金债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析和严格的风险控制基础上，综合考虑经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响，深入挖掘价值被低估的标的券种。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率                                                                                                                                                             |

|        |                                                              |
|--------|--------------------------------------------------------------|
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低预期收益和预期风险的产品。 |
|--------|--------------------------------------------------------------|

## 2.2 基金产品说明（转型前）

|        |                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在严格控制风险的前提下追求基金资产长期稳健增值，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。                                                                                                                                                                                                        |
| 投资策略   | <p>本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>(1) 封闭期投资策略</p> <p>在本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配的基础上，通过自上而下的定性分析和定量分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。</p> <p>(2) 开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p> |
| 业绩比较基准 | 6 个月定期存款利率（税后）                                                                                                                                                                                                                                            |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中等预期收益和预期风险的产品。                                                                                                                                                                                              |

## 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                                    | 陆志俊                     |
|         | 联系电话 | 021-60371155                           | 95559                   |
|         | 电子邮箱 | zhaozz@chinanature.com.cn              | luzj@bankcomm.com       |
| 客户服务电话  |      | 400-098-4800（免长途通话费用）、<br>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                                     | 彭纯                      |

## 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》                |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.chinanature.com.cn |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人的办公场所       |

## 2.5 其他相关资料

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



### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |           |
|---------------|------------------------------------------|-----------|
|               | 天治鑫利纯债 A                                 | 天治鑫利纯债 C  |
| 本期已实现收益       | -139,486.47                              | -307.30   |
| 本期利润          | -110,474.57                              | -244.11   |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0136                                  | -0.0078   |
| 本期加权平均净值利润率   | -1.30%                                   | -0.75%    |
| 本期基金份额净值增长率   | -1.10%                                   | -1.26%    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年 6 月 30 日                          |           |
| 期末可供分配利润      | 280,941.48                               | 391.94    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0405                                   | 0.0297    |
| 期末基金资产净值      | 7,225,397.74                             | 13,576.25 |
| 期末基金份额净值      | 1.0405                                   | 1.0297    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2019 年 6 月 30 日                          |           |
| 基金份额累计净值增长率   | -1.10%                                   | -1.26%    |

注：1、上述基金业绩指标不包括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）。

转型前

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日 |           |
|---------------|--------------------------------|-----------|
|               | 天治鑫利 A                         | 天治鑫利 C    |
| 本期已实现收益       | 646,628.83                     | 2,532.98  |
| 本期利润          | 169,278.12                     | 1,372.55  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0070                         | 0.0083    |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.66%                          | 0.80%     |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.01%                          | -0.08%    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年 3 月 6 日                 |           |
| 期末可供分配利润      | 524,079.53                     | 2,839.45  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0521                         | 0.0428    |
| 期末基金资产净值      | 10,577,700.07                  | 69,233.07 |

|                     |                |        |
|---------------------|----------------|--------|
| 期末基金份额净值            | 1.0521         | 1.0428 |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | 2019 年 3 月 6 日 |        |
| 基金份额累计净值增长率         | 5.21%          | 4.28%  |

注：1、上述基金业绩指标不包括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（转型后）

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天治鑫利纯债 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.93%    | 0.20%       | 0.57%      | 0.03%         | 0.36%  | 0.17% |
| 过去三个月      | -1.46%   | 0.18%       | 0.63%      | 0.06%         | -2.09% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.10%   | 0.17%       | 1.17%      | 0.06%         | -2.27% | 0.11% |

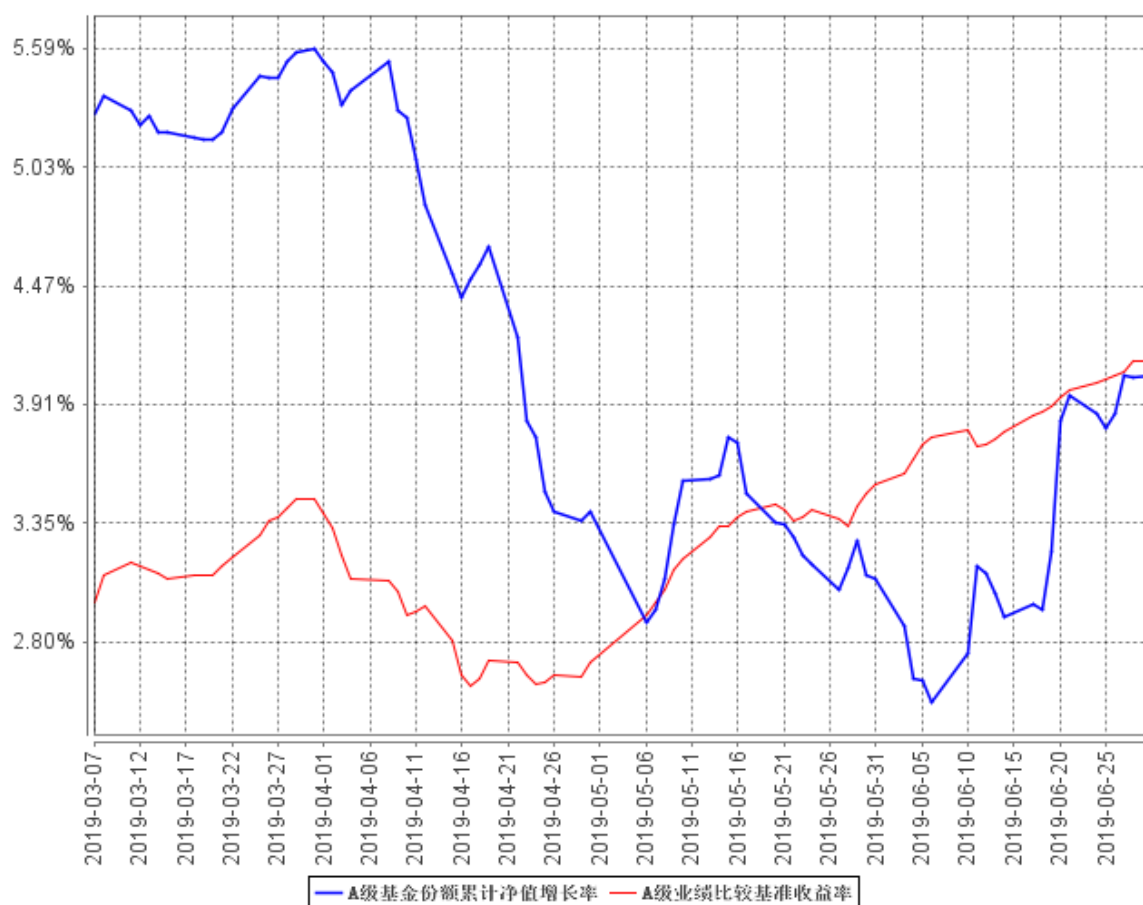
天治鑫利纯债 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.89%    | 0.20%       | 0.57%      | 0.03%         | 0.32%  | 0.17% |
| 过去三个月      | -1.58%   | 0.19%       | 0.63%      | 0.06%         | -2.21% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.26%   | 0.17%       | 1.17%      | 0.06%         | -2.43% | 0.11% |

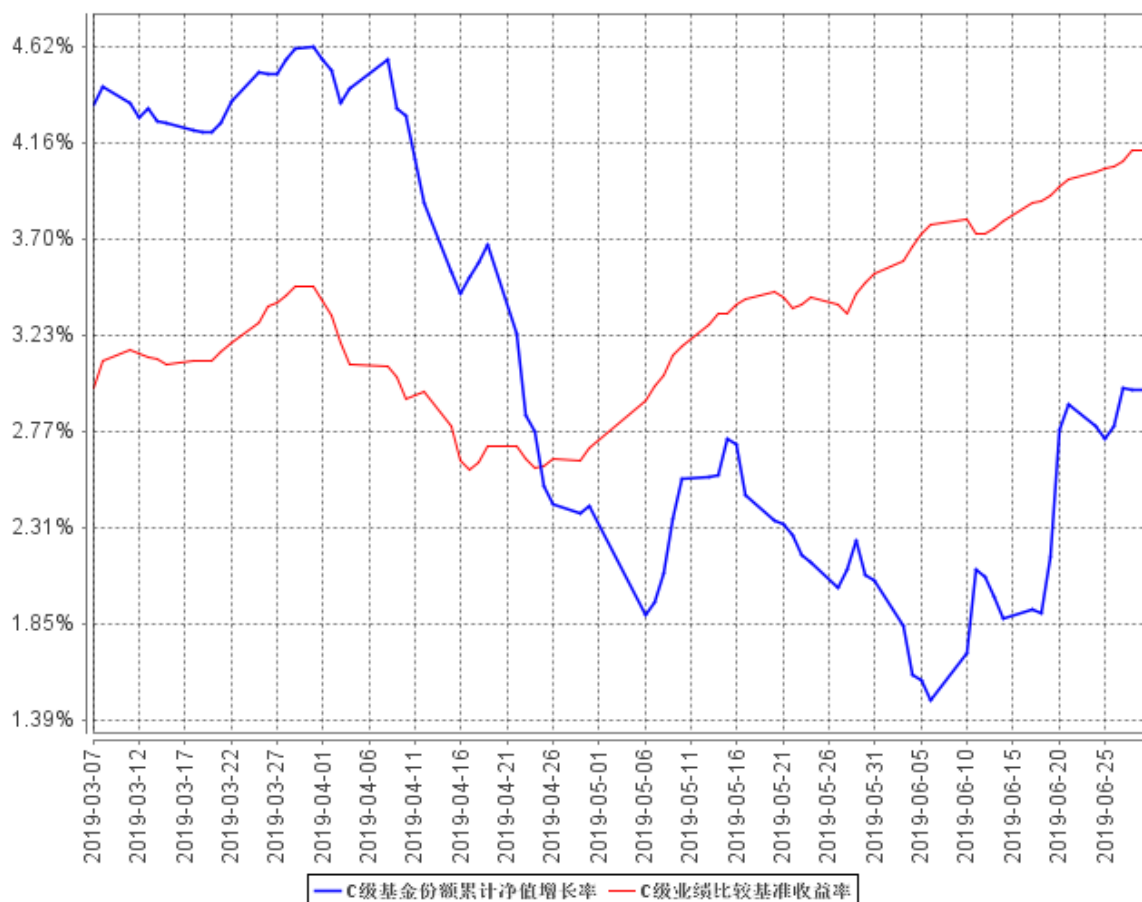
注：自基金合同生效起至今为 2019 年 3 月 7 日-2019 年 6 月 30 日。

### 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2019 年 3 月 7 日由原天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型而来。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天治鑫利 A

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月          | -0.54%       | 0.10%               | 0.12%              | 0.01%                 | -0.66% | 0.09% |
| 过去三个月          | 0.34%        | 0.09%               | 0.32%              | 0.00%                 | 0.02%  | 0.09% |
| 过去六个月          | 1.61%        | 0.07%               | 0.64%              | 0.00%                 | 0.97%  | 0.07% |
| 过去一年           | 3.48%        | 0.06%               | 1.30%              | 0.00%                 | 2.18%  | 0.06% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 5.21%        | 0.07%               | 2.92%              | 0.00%                 | 2.29%  | 0.07% |

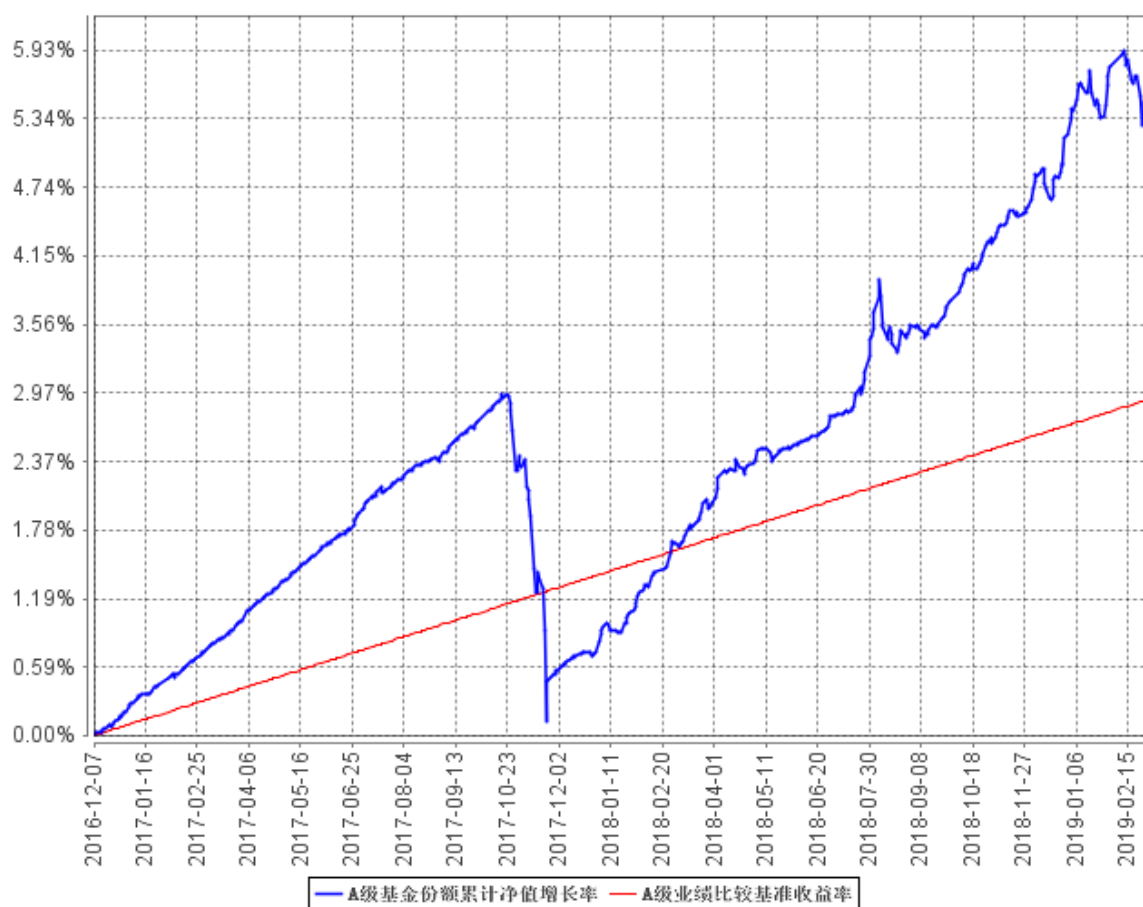
天治鑫利 C

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月          | -0.57%       | 0.10%               | 0.12%              | 0.01%                 | -0.69% | 0.09% |
| 过去三个月          | 0.23%        | 0.09%               | 0.32%              | 0.00%                 | -0.09% | 0.09% |
| 过去六个月          | 1.39%        | 0.06%               | 0.64%              | 0.00%                 | 0.75%  | 0.06% |
| 过去一年           | 3.04%        | 0.06%               | 1.30%              | 0.00%                 | 1.74%  | 0.06% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 4.28%        | 0.07%               | 2.92%              | 0.00%                 | 1.36%  | 0.07% |

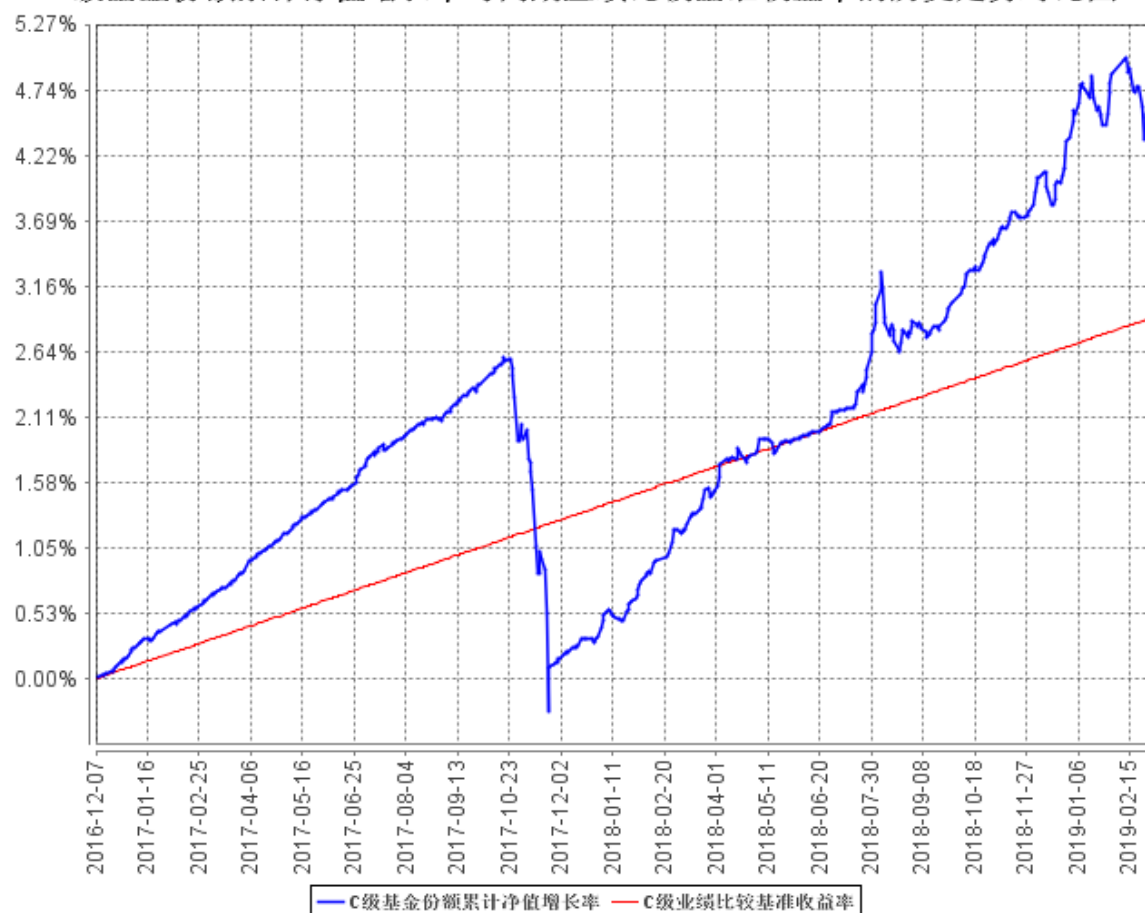
注：自基金合同生效起至今为 2016 年 12 月 7 日-2019 年 3 月 6 日。

### 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 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 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下共有十三只开放式基金，除本基金外，另外十二只基金——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 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（转型后）

| 姓名  | 职务                      | 任本基金的基金经理（助理）期限  |      | 证券从业年限 | 说明                                                         |
|-----|-------------------------|------------------|------|--------|------------------------------------------------------------|
|     |                         | 任职日期             | 离任日期 |        |                                                            |
| 向桂英 | 本基金基金经理、天治天得利货币市场基金基金经理 | 2016 年 12 月 23 日 | —    | 8 年    | 硕士研究生，具有基金从业资格，历任本公司交易员、交易部副总监，现任本基金的基金经理、天治天得利货币市场基金基金经理。 |

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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

| 姓名  | 职务                      | 任本基金的基金经理（助理）期限  |      | 证券从业年限 | 说明                                                         |
|-----|-------------------------|------------------|------|--------|------------------------------------------------------------|
|     |                         | 任职日期             | 离任日期 |        |                                                            |
| 向桂英 | 本基金基金经理、天治天得利货币市场基金基金经理 | 2016 年 12 月 23 日 | -    | 8 年    | 硕士研究生，具有基金从业资格，历任本公司交易员、交易部副总监，现任本基金的基金经理、天治天得利货币市场基金基金经理。 |

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

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《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》、《天治鑫利纯债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，本基金管理人管理的所有投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易的情形。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

2019 年一季度，一季度社融数据超出市场预期，市场对于经济企稳的预期增强。由于非洲猪瘟影响，猪肉价格持续上涨，一季度上涨近 20%，市场对通胀的预期增强。一季度地方债发行 1.4 万亿，利率债市场供给明显增加。在多方面影响下，一季度债券市场收益率略有上行。二季度，货币政策依然保持宽松态势，资金面总量宽松，但由于金融供给侧改革影响，市场对信用等级较低的机构提高风控标准，造成整个资金面阶段性出现分层现象，因而现券市场信用利差也较一季度略有扩大。随着市场信心的逐步恢复，资金面分层的现象有望逐步缓解，而公开市场操作自然到期，资金面可能边际上收紧。内忧外患的大背景下，宏观经济增速下行压力犹存，美联储降息预期开启，全球新一轮降息周期开启。因此，国内货币政策灵活的空间更大，预计三季度资金面依然呈现宽松态势。由于地方债发行放量和信用偏好下降双重影响，现券市场收益率小区间震荡。由于宏观经济增速仍然有一定的下行压力，社融增速难有明显提高，因此，预计无风险利率还有进一步下行的空间。

在此宏观背景下，本基金 2019 年上半年的投资运作基本根据这一市场节奏不断调整资产配置，增加了转债配置，结合本产品的特点和目标客户群，我们采用较灵活的交易策略，力争控制回撤，为持有人带来稳健可持续的投资回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末（2019 年 6 月 30 日），本基金 A 类份额净值为 1.0405 元，C 类份额净值为 1.0297 元；本报告期（2019 年 3 月 7 日-2019 年 6 月 30 日），本基金 A 类份额净值增长率为-1.10%，业绩比较基准收益率为 1.17%，低于同期业绩比较基准收益率 2.27%；C 类份额净值增长率为-1.26%，业绩比较基准收益率为 1.17%，低于同期业绩比较基准收益率 2.43%。

截至转型前报告期末（2019 年 3 月 6 日），本基金 A 类份额净值为 1.0521 元，C 类份额净值为 1.0428 元；报告期末（2019 年 3 月 6 日）前三个月内，本基金 A 类份额净值增长率为 0.34%，

业绩比较基准收益率为 0.32%，高于同期业绩比较基准收益率 0.02%；C 类份额净值增长率为 0.23%，业绩比较基准收益率为 0.32%，低于同期业绩比较基准收益率 0.09%。

#### 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，在“房住不炒”的大背景下，房地产投资增速有望明显回落，基建投资受地方债务约束，对经济增长的拉动作用有限，而中美贸易战持续发酵，整个外围市场经济增长同样乏力，进出口增速也不乐观。虽然降税对消费有部分拉动作用，但今年以来，居民杠杆率持续上升，消费增长后劲不足。综上，我们判断，下半年经济依然在筑底阶段，货币政策依然较宽松，无风险利率难有明显上行。而政策面上，鼓励进一步增加直接融资，因此权益市场将出现更多优质公司，看好可转债结构性行情。

#### 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、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

转型前，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元、基金持有人数少于 200 人的情形，出现上述情形的时间段为 2019 年 1 月 15 日至 2019 年 3 月 6 日。

转型后，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元、基金持有人数少于 200 人的情形，出现上述情形的时间段为 2019 年 3 月 7 日至 2019 年 6 月 30 日。本基金管理人已于 2019 年 6 月 10 日向中国证监会报告了相关事宜及解决方案。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

报告期内，基金托管人在本基金的托管过程中的托管过程中，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合规守信、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，本基金未实施利润分配。

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

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）（转型后）

## 6.1 资产负债表

会计主体：天治鑫利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 465,802.49                     |
| 结算备付金           |            | 13,107.89                      |
| 存出保证金           |            | 3,650.66                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 6,671,289.50                   |
| 其中：股票投资         |            | —                              |
| 基金投资            |            | —                              |
| 债券投资            |            | 6,671,289.50                   |
| 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         |            | —                              |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 110,545.11                     |
| 应收股利            |            | —                              |
| 应收申购款           |            | —                              |
| 递延所得税资产         |            | —                              |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | —                              |
| 资产总计            |            | 7,264,395.65                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 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       |            | —                              |
| 应付证券清算款         |            | —                              |
| 应付赎回款           |            | —                              |
| 应付管理人报酬         |            | 4,188.28                       |
| 应付托管费           |            | 1,196.62                       |
| 应付销售服务费         |            | 4.50                           |

|               |          |              |
|---------------|----------|--------------|
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 162.50       |
| 应交税费          |          | 33.97        |
| 应付利息          |          | -            |
| 应付利润          |          | -            |
| 递延所得税负债       |          | -            |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 19,835.79    |
| 负债合计          |          | 25,421.66    |
| <b>所有者权益：</b> |          |              |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 6,957,640.57 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 281,333.42   |
| 所有者权益合计       |          | 7,238,973.99 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 7,264,395.65 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0404 元，基金份额总额 6,957,640.57 份，其中 A 类基金份额净值 1.0405 元，基金份额总额 6,944,456.26 份；C 类基金份额净值 1.0297 元，基金份额总额 13,184.31 份。

## 6.2 利润表

会计主体：天治鑫利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|---------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            |            | -59,278.74                                        |
| 1. 利息收入                |            | 92,790.65                                         |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 3,169.71                                          |
| 债券利息收入                 |            | 89,620.94                                         |
| 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）      |            | -181,144.48                                       |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | -                                                 |
| 基金投资收益                 |            | -                                                 |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | -181,144.48                                       |
| 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   | -                                                 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 29,075.09                                         |

|                            |            |             |
|----------------------------|------------|-------------|
| 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   | -           |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 51,439.94   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 18,838.57   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 5,382.41    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 40.17       |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 645.67      |
| 5. 利息支出                    |            | 3,447.94    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 3,447.94    |
| 6. 税金及附加                   |            | 11.58       |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 23,073.60   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -110,718.68 |
| 减：所得税费用                    |            | -           |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -110,718.68 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治鑫利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 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）                        | 10,120,014.16                                  | 526,918.98  | 10,646,933.14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                              | -110,718.68 | -110,718.68   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | -3,162,373.59                                  | -134,866.88 | -3,297,240.47 |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                                              | -           | -             |
| 2. 基金赎回款（以“-”号填列）                      | -3,162,373.59                                  | -134,866.88 | -3,297,240.47 |
| 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）                        | 6,957,640.57                                   | 281,333.42  | 7,238,973.99  |

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：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <u>徐克磊</u> | <u>闫译文</u> | <u>黄宇星</u> |
| 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

天治鑫利纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型而成，天治鑫利半年定期开放债券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[2016]1652 号《关于准予天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人天治基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2016 年 12 月 7 日正式生效，首次设立募集规模为 435,407,203.13 份基金份额。根据《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》及《天治基金管理有限公司关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2019 年 3 月 7 日起转型并更名为天治鑫利纯债债券型证券投资基金。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为天治基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（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、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、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）。本基金不投资于股票、权证等资产。本基金通过可分离交易可转债认购所获得的认股权证，在其可上市交易后 10 个交易日内全部卖出。本基金所持可转换债券转股获得的股票在其可上市交易后的 10 个交易日内全部卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率。



## 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》、《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<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 3 月 7 日（基金合同转型日）起至 2019 年 6 月 30 日止期间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 2018 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

### 1. 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。

## 2. 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。

## 3. 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[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。

## 4. 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。

### 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<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 465,802.49             |
| 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：            | 465,802.49             |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |              |              |
|---------------|------------------------|--------------|--------------|
|               | 成本                     | 公允价值         | 估值增值         |
| 股票            | -                      | -            | -            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -            | -            |
| 债券            | 交易所市场                  | 6,695,527.59 | 6,671,289.50 |
|               | 银行间市场                  | -            | -            |
|               | 合计                     | 6,695,527.59 | 6,671,289.50 |
| 资产支持证券        | -                      | -            | -            |
| 基金            | -                      | -            | -            |
| 其他            | -                      | -            | -            |
| 合计            | 6,695,527.59           | 6,671,289.50 | -24,238.09   |

#### 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<br>2019 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 988.34                 |
| 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  | 5.31                   |
| 应收债券利息     | 109,549.93             |
| 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 | -                      |
| 其他         | 1.53                   |
| 合计         | 110,545.11             |

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：无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                      |
| 银行间市场应付交易费用 | 162.50                 |
| 合计          | 162.50                 |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 预提费用        | 19,835.79              |
| 合计          | 19,835.79              |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 天治鑫利纯债 A |    |
|----------|----|
| 项目       | 本期 |

|               | 2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |               |
|---------------|------------------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                                  | 账面金额          |
| 基金合同生效日       | 10,053,620.54                            | 10,053,620.54 |
| 基金份额折算调整      | -                                        | -             |
| 未领取红利份额折算调整   | -                                        | -             |
| 集中申购募集资金本金及利息 | -                                        | -             |
| 基金拆分和集中申购完成后  | -                                        | -             |
| 本期申购          | -                                        | -             |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -3,109,164.28                            | -3,109,164.28 |
| 本期末           | 6,944,456.26                             | 6,944,456.26  |

金额单位：人民币元

| 天治鑫利纯债 C      |                                                |            |
|---------------|------------------------------------------------|------------|
| 项目            | 本期<br>2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |            |
|               | 基金份额（份）                                        | 账面金额       |
| 基金合同生效日       | 66,393.62                                      | 66,393.62  |
| 基金份额折算调整      | -                                              | -          |
| 未领取红利份额折算调整   | -                                              | -          |
| 集中申购募集资金本金及利息 | -                                              | -          |
| 基金拆分和集中申购完成后  | -                                              | -          |
| 本期申购          | -                                              | -          |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -53,209.31                                     | -53,209.31 |
| 本期末           | 13,184.31                                      | 13,184.31  |

## 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

| 天治鑫利纯债 A       |             |             |             |
|----------------|-------------|-------------|-------------|
| 项目             | 已实现部分       | 未实现部分       | 未分配利润合计     |
| 基金合同生效日        | 728,186.78  | -204,107.25 | 524,079.53  |
| 本期利润           | -139,486.47 | 29,011.90   | -110,474.57 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -203,679.62 | 71,016.14   | -132,663.48 |
| 其中：基金申购款       | -           | -           | 0.00        |
| 基金赎回款          | -203,679.62 | 71,016.14   | -132,663.48 |
| 本期已分配利润        | -           | -           | -           |
| 本期末            | 385,020.69  | -104,079.21 | 280,941.48  |

金额单位：人民币元

| 天治鑫利纯债 C       |           |           |           |
|----------------|-----------|-----------|-----------|
| 项目             | 已实现部分     | 未实现部分     | 未分配利润合计   |
| 基金合同生效日        | 4,175.06  | -1,335.61 | 2,839.45  |
| 本期利润           | -307.30   | 63.19     | -244.11   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,279.90 | 1,076.50  | -2,203.40 |
| 其中：基金申购款       | -         | -         | 0.00      |
| 基金赎回款          | -3,279.90 | 1,076.50  | -2,203.40 |
| 本期已分配利润        | -         | -         | -         |
| 本期末            | 587.86    | -195.92   | 391.94    |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

| 项目        | 本期<br>2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 2,891.81                                       |
| 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 | 244.80                                         |
| 其他        | 33.10                                          |
| 合计        | 3,169.71                                       |

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——买卖股票差价收入。

#### 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<br>2019年3月7日至2019年6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 | -181,144.48                |
| 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                            | -181,144.48                |

##### 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<br>2019年3月7日至2019年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 25,418,897.34              |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 25,219,166.84              |
| 减：应收利息总额                | 380,874.98                 |
| 买卖债券差价收入                | -181,144.48                |

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019<br>年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 29,075.09                                         |
| ——股票投资                     | —                                                 |
| ——债券投资                     | 29,075.09                                         |
| ——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<br>增值税 | —                                                 |
| 合计                         | 29,075.09                                         |

#### 6.4.7.18 其他收入

注：无。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年<br>6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 145.67                                            |
| 银行间市场交易费用 | 500.00                                            |
| 交易基金产生的费用 | —                                                 |
| 其中：申购费    | —                                                 |
| 赎回费       | —                                                 |
| 合计        | 645.67                                            |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019<br>年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------------------|
| 审计费用  | 12,712.44                                         |
| 信息披露费 | —                                                 |
| 其他    | 300.00                                            |



|        |           |
|--------|-----------|
| 账户维护费  | 9,000.00  |
| 银行汇划费用 | 1,061.16  |
| 合计     | 23,073.60 |

#### 6.4.7.21 分部报告

—

#### 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 |
| 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

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 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。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**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                                       |
|-----------------|------------------------------------------|
|                 | 2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 18,838.57                                |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 10,779.22                                |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 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付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，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                                       |
|----------------|------------------------------------------|
|                | 2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,382.41                                 |

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 本期<br>2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日<br>当期发生的基金应支付的销售服务费 |          |      |
|--------------------|--------------------------------------------------------------------|----------|------|
|                    | 天治鑫利纯债 A                                                           | 天治鑫利纯债 C | 合计   |
|                    |                                                                    |          |      |
| 天治基金管理有限公司         | -                                                                  | 3.45     | 3.45 |
| 交通银行股份有限公司         | -                                                                  | 1.16     | 1.16 |
| 合计                 | -                                                                  | 4.61     | 4.61 |

注：A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

**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于本报告期末及上年度末均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<br>2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |          |
|------------|------------------------------------------------|----------|
|            | 期末余额                                           | 当期利息收入   |
| 交通银行股份有限公司 | 465,802.49                                     | 2,891.81 |

**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****6.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2019 年 6 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：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

**6.4.12.17 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。

**6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.18.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 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。

**6.4.12.18.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 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证券款余额。

**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。

自 2019 年 3 月 7 日起，本基金转型为天治鑫利纯债债券型基金，在基金转型后，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

金额单位：人民币元

| 本期末<br>2019 年 6 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                   | 465,802.49 | -      | -            | -            | -     | -          | 465,802.49   |
| 结算备付金                  | 13,107.89  | -      | -            | -            | -     | -          | 13,107.89    |
| 存出保证金                  | 3,650.66   | -      | -            | -            | -     | -          | 3,650.66     |
| 交易性金融资产                | 98,760.00  | -      | 3,266,995.20 | 3,305,534.30 | -     | -          | 6,671,289.50 |
| 应收利息                   | -          | -      | -            | -            | -     | 110,545.11 | 110,545.11   |
| 资产总计                   | 581,321.04 | -      | 3,266,995.20 | 3,305,534.30 | -     | 110,545.11 | 7,264,395.65 |
| 负债                     |            |        |              |              |       |            |              |
| 应付管理人报酬                | -          | -      | -            | -            | -     | 4,188.28   | 4,188.28     |
| 应付托管费                  | -          | -      | -            | -            | -     | 1,196.62   | 1,196.62     |
| 应付销售服务费                | -          | -      | -            | -            | -     | 4.50       | 4.50         |
| 应付交易费用                 | -          | -      | -            | -            | -     | 162.50     | 162.50       |
| 应交税费                   | -          | -      | -            | -            | -     | 33.97      | 33.97        |
| 其他负债                   | -          | -      | -            | -            | -     | 19,835.79  | 19,835.79    |
| 负债总计                   | -          | -      | -            | -            | -     | 25,421.66  | 25,421.66    |
| 利率敏感度缺口                | 581,321.04 | -      | 3,266,995.20 | 3,305,534.30 | -     | 85,123.45  | 7,238,973.99 |

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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（2019 年 6 月 30 日）        |
|    | 利率上升 25 个基点                         | -12,349.72                  |
|    | 利率下降 25 个基点                         | 12,349.72                   |

**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<br>2019 年 6 月 30 日 |              |
|---------------|------------------------|--------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | —                      | —            |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —            |
| 交易性金融资产—债券投资  | 6,671,289.50           | 92.16        |
| 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            | 6,671,289.50           | 92.16        |

**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（ 2019 年 6 月 30 日 ） |            |
|--|------------------------|------------|
|  | 业绩比较基准变动+5%            | 95,230.93  |
|  | 业绩比较基准变动-5%            | -95,230.93 |

#### 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。



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

## 6.1 资产负债表

会计主体：天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 3 月 6 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2019 年 3 月 6 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|-------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                               |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 191,590.99                    | 531,107.41                       |
| 结算备付金           |            | 90,632.56                     | 190,954.15                       |
| 存出保证金           |            | 8,176.18                      | 13,141.04                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 13,948,578.40                 | 65,761,949.80                    |
| 其中：股票投资         |            | -                             | -                                |
| 基金投资            |            | -                             | -                                |
| 债券投资            |            | 13,948,578.40                 | 65,761,949.80                    |
| 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    | -                             | 8,000,132.00                     |
| 应收证券清算款         |            | -                             | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 295,845.46                    | 1,308,378.56                     |
| 应收股利            |            | -                             | -                                |
| 应收申购款           |            | -                             | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                             | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                             | -                                |
| 资产总计            |            | 14,534,823.59                 | 75,805,662.96                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 3 月 6 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 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       |            | 1,500,000.00                  | 19,199,851.20                    |
| 应付证券清算款         |            | 124,127.78                    | -                                |
| 应付赎回款           |            | 2,212,413.24                  | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 1,546.05                      | 33,331.86                        |
| 应付托管费           |            | 441.72                        | 9,523.38                         |
| 应付销售服务费         |            | 4.56                          | 165.16                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 1,569.25                      | 2,110.76                         |
| 应交税费            |            | -                             | 371.27                           |

|               |          |               |               |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应付利息          |          | 664.50        | 13,274.70     |
| 应付利润          |          | -             | -             |
| 递延所得税负债       |          | -             | -             |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 47,123.35     | 280,000.00    |
| 负债合计          |          | 3,887,890.45  | 19,538,628.33 |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |               |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 10,120,014.16 | 53,490,189.88 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 526,918.98    | 2,776,844.75  |
| 所有者权益合计       |          | 10,646,933.14 | 56,267,034.63 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 14,534,823.59 | 75,805,662.96 |

注：报告截止日 2019 年 3 月 6 日，基金份额净值 1.0521 元，基金份额总额 10,120,014.16 份，其中 A 类基金份额净值 1.0521 元，份额总额 10,053,620.54 份；C 类基金份额净值 1.0428 元，份额总额 66,393.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 3 月 6 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|-----------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            |            | 262,533.13                              | 1,091,050.61                                  |
| 1. 利息收入                |            | 199,172.31                              | 799,085.07                                    |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 7,707.92                                | 18,826.43                                     |
| 债券利息收入                 |            | 171,227.11                              | 633,518.92                                    |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                                       | -                                             |
| 买入返售金融资产收入             |            | 20,237.28                               | 146,739.72                                    |
| 其他利息收入                 |            | -                                       | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 541,871.96                              | 256,617.07                                    |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | -                                       | -                                             |
| 基金投资收益                 |            | -                                       | -                                             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | 541,871.96                              | 256,617.07                                    |
| 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   | -                                       | -                                             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -478,511.14                             | 35,348.47                                     |
| 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   | -          | -          |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 91,882.46  | 401,063.20 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 30,860.07  | 123,051.00 |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 8,817.15   | 35,157.43  |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 118.56     | 1,026.80   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 1,078.59   | 1,998.74   |
| 5. 利息支出                    |            | 23,186.49  | 77,573.24  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 23,186.49  | 77,573.24  |
| 6. 税金及附加                   |            | 3.56       | 394.75     |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 27,818.04  | 161,861.24 |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 170,650.67 | 689,987.41 |
| 减：所得税费用                    |            | -          | -          |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 170,650.67 | 689,987.41 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 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）                        | 53,490,189.88                        | 2,776,844.75  | 56,267,034.63  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                    | 170,650.67    | 170,650.67     |
| 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）      | -43,370,175.72                       | -2,420,576.44 | -45,790,752.16 |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                                    | -             | -              |
| 2. 基金赎回款                               | -43,370,175.72                       | -2,420,576.44 | -45,790,752.16 |
| 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）                        | 10,120,014.16                        | 526,918.98    | 10,646,933.14  |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 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）                        | 35,068,943.56                              | 255,409.20  | 35,324,352.76  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | 689,987.41  | 689,987.41     |
| 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）      | -15,710,943.96                             | -414,662.79 | -16,125,606.75 |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                                          | -           | -              |
| 2. 基金赎回款                               | -15,710,943.96                             | -414,662.79 | -16,125,606.75 |
| 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）                        | 19,357,999.60                              | 530,733.82  | 19,888,733.42  |

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：

|              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|
| _____<br>徐克磊 | _____<br>闫译文 | _____<br>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

天治鑫利半年定期开放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[2016]1652 号《关于准予天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人天治基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2016 年 12 月 7 日正式生效，首次设立募集规模为 435,407,203.13 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为天治基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》及《天治基金管理有限公司关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2019 年 3 月 7 日起转型并更名为天治鑫利纯债债券型证券投资基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不直接买入股票、权证、可转换债等。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。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；但在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期，本基金不受上述 5% 的限制，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：6 个月定期存款利率（税后）。

#### 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》、《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<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

根据《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》及《天治基金管理有限公司关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2019 年 3 月 7 日起转型为天治鑫利纯债债券型证券投资基金继续运作，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 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 2019 年 3 月 6 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 3 月 6 日止期间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 2018 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

##### 1. 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。

## 2. 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。

## 3. 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[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。

## 4. 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。

# 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<br>2019 年 3 月 6 日 |
|----------------|-----------------------|
| 活期存款           | 191,590.99            |
| 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：            | 191,590.99            |

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019 年 3 月 6 日 |               |               |
|---------------|-----------------------|---------------|---------------|
|               | 成本                    | 公允价值          | 估值增值          |
| 股票            | -                     | -             | -             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                     | -             | -             |
| 债券            | 交易所市场                 | 3,837,131.58  | 3,821,578.40  |
|               | 银行间市场                 | 10,164,760.00 | 10,127,000.00 |
|               | 合计                    | 14,001,891.58 | 13,948,578.40 |
| 资产支持证券        | -                     | -             | -             |
| 基金            | -                     | -             | -             |
| 其他            | -                     | -             | -             |
| 合计            | 14,001,891.58         | 13,948,578.40 | -53,313.18    |

**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<br>2019 年 3 月 6 日 |
|------------|-----------------------|
| 应收活期存款利息   | 7,674.45              |
| 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  | 481.03                |
| 应收债券利息     | 287,644.07            |
| 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 | -                     |
| 其他         | 45.91                 |
| 合计         | 295,845.46            |



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：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019 年 3 月 6 日 |
|-------------|-----------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | —                     |
| 银行间市场应付交易费用 | 1,569.25              |
| 合计          | 1,569.25              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019 年 3 月 6 日 |
|-------------|-----------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                     |
| 应付赎回费       | —                     |
| 预提费用        | 47,123.35             |
| 合计          | 47,123.35             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 天治鑫利 A        |                                      |                |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
| 项目            | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日 |                |
|               | 基金份额（份）                              | 账面金额           |
| 上年度末          | 53,022,778.26                        | 53,022,778.26  |
| 本期申购          | —                                    | —              |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -42,969,157.72                       | -42,969,157.72 |
| — 基金拆分/份额折算前  | —                                    | —              |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | —                                    | —              |
| 本期申购          | —                                    | —              |
| 本期赎回(以“-”号填列) | —                                    | —              |
| 本期末           | 10,053,620.54                        | 10,053,620.54  |

金额单位：人民币元

| 天治鑫利 C |    |
|--------|----|
| 项目     | 本期 |

|               | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日 |             |
|---------------|--------------------------------|-------------|
|               | 基金份额（份）                        | 账面金额        |
| 上年度末          | 467,411.62                     | 467,411.62  |
| 本期申购          | -                              | -           |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -401,018.00                    | -401,018.00 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                              | -           |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                              | -           |
| 本期申购          | -                              | -           |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                              | -           |
| 本期末           | 66,393.62                      | 66,393.62   |

#### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

| 天治鑫利 A         |               |             |               |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分       | 未分配利润合计       |
| 上年度末           | 2,346,857.76  | 409,594.64  | 2,756,452.40  |
| 本期利润           | 646,628.83    | -477,350.71 | 169,278.12    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,265,299.81 | -136,351.18 | -2,401,650.99 |
| 其中：基金申购款       | -             | -           | -             |
| 基金赎回款          | -2,265,299.81 | -136,351.18 | -2,401,650.99 |
| 本期已分配利润        | -             | -           | -             |
| 本期末            | 728,186.78    | -204,107.25 | 524,079.53    |

金额单位：人民币元

| 天治鑫利 C         |            |           |            |
|----------------|------------|-----------|------------|
| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分     | 未分配利润合计    |
| 上年度末           | 16,807.06  | 3,585.29  | 20,392.35  |
| 本期利润           | 2,532.98   | -1,160.43 | 1,372.55   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -15,164.98 | -3,760.47 | -18,925.45 |
| 其中：基金申购款       | -          | -         | -          |
| 基金赎回款          | -15,164.98 | -3,760.47 | -18,925.45 |
| 本期已分配利润        | -          | -         | -          |
| 本期末            | 4,175.06   | -1,335.61 | 2,839.45   |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日 |
|----------|--------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 7,272.78                             |
| 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 | 395.13   |
| 其他        | 40.01    |
| 合计        | 7,707.92 |

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——买卖股票差价收入。

#### 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<br>2019年1月1日至2019年3月6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 | 541,871.96                |
| 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                            | 541,871.96                |

##### 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<br>2019年1月1日至2019年3月6日 |
|-------------------------|---------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额   | 68,061,721.48             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 66,068,171.96             |
| 减：应收利息总额                | 1,451,677.56              |
| 买卖债券差价收入                | 541,871.96                |

##### 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**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日 |
|------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -478,511.14                          |
| ——股票投资     | -                                    |
| ——债券投资     | -478,511.14                          |
| ——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                     | -478,511.14 |

#### 6.4.7.18 其他收入

注：无。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日 |
|-----------|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 16.09                                |
| 银行间市场交易费用 | 1,062.50                             |
| 交易基金产生的费用 | -                                    |
| 其中：申购费    | -                                    |
| 赎回费       | -                                    |
| 合计        | 1,078.59                             |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日 |
|--------|--------------------------------------|
| 审计费用   | 7,123.35                             |
| 信息披露费  | -                                    |
| 其他     | 10,300.00                            |
| 账户维护费  | 9,000.00                             |
| 银行汇划费用 | 1,394.69                             |
| 合计     | 27,818.04                            |

#### 6.4.7.21 分部报告

-

### 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 |
| 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

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 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。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3<br>月 6 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30<br>日 |
|------------------------------|-----------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费               | 30,860.07                               | 123,051.00                                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup> | 11,250.56                               | 72,190.76                                     |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 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付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3<br>月 6 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30<br>日 |
|----------------|-----------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 8,817.15                                | 35,157.43                                     |

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日 |
|----------------|--------------------------------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                     |

|                | 天治鑫利 A                                     | 天治鑫利 C | 合计   |
|----------------|--------------------------------------------|--------|------|
| 天治基金管理有限公司     | -                                          | 1.90   | 1.90 |
| 交通银行股份有限公司     | -                                          | 0.65   | 0.65 |
| 合计             | -                                          | 2.55   | 2.55 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |        |      |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |        |      |
|                | 天治鑫利 A                                     | 天治鑫利 C | 合计   |
|                |                                            |        |      |
| 天治基金管理有限公司     | -                                          | -      | -    |
| 交通银行股份有限公司     | -                                          | 1.77   | 1.77 |
| 合计             | -                                          | 1.77   | 1.77 |

注：A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times C$  类基金销售服务费年费率 / 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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于本报告期末及上年度末均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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日 |          | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 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 | 191,590.99                           | 7,272.78 | 1,804,410.21                               | 18,164.91 |



**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****6.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2019 年 3 月 6 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：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票**

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 2019 年 3 月 6 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 2019 年 3 月 6 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 1,500,000 元，于 2019 年 3 月 7 日到期。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。

本基金采用定期开放的运作方式，封闭期内不得申请申购、赎回本基金。在开放期内，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

金额单位：人民币元

| 本期末<br>2019年3月6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             | 191,590.99   | -     | -      | -             | -          | -          | 191,590.99    |
| 结算备付金            | 90,632.56    | -     | -      | -             | -          | -          | 90,632.56     |
| 存出保证金            | 8,176.18     | -     | -      | -             | -          | -          | 8,176.18      |
| 交易性金融资产          | 600,720.00   | -     | -      | 13,055,858.40 | 292,000.00 | -          | 13,948,578.40 |
| 应收利息             | -            | -     | -      | -             | -          | 295,845.46 | 295,845.46    |
| 其他资产             | -            | -     | -      | -             | -          | -          | -             |
| 资产总计             | 891,119.73   | -     | -      | 13,055,858.40 | 292,000.00 | 295,845.46 | 14,534,823.59 |
| 负债               |              |       |        |               |            |            |               |
| 卖出回购金融资产款        | 1,500,000.00 | -     | -      | -             | -          | -          | 1,500,000.00  |
| 应付证              | -            | -     | -      | -             | -          | 124,127.78 | 124,127.78    |

|                          |              |               |               |                |              |               |                |
|--------------------------|--------------|---------------|---------------|----------------|--------------|---------------|----------------|
| 券清算款                     |              |               |               |                |              |               |                |
| 应付赎回款                    |              | -             | -             | -              | -            | 2,212,413.24  | 2,212,413.24   |
| 应付管理人报酬                  |              | -             | -             | -              | -            | 1,546.05      | 1,546.05       |
| 应付托管费                    |              | -             | -             | -              | -            | 441.72        | 441.72         |
| 应付销售服务费                  |              | -             | -             | -              | -            | 4.56          | 4.56           |
| 应付交易费用                   |              | -             | -             | -              | -            | 1,569.25      | 1,569.25       |
| 应付利息                     |              | -             | -             | -              | -            | 664.50        | 664.50         |
| 其他负债                     |              | -             | -             | -              | -            | 47,123.35     | 47,123.35      |
| 负债总计                     | 1,500,000.00 | -             | -             | -              | -            | 2,387,890.45  | 3,887,890.45   |
| 利率敏感度缺口                  | -608,880.27  | -             | -             | -13,055,858.40 | 292,000.00   | -2,092,044.99 | 10,646,933.14  |
| 上年度末<br>2018 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                     | 531,107.41   | -             | -             | -              | -            | -             | 531,107.41     |
| 结算备付金                    | 190,954.15   | -             | -             | -              | -            | -             | 190,954.15     |
| 存出保证金                    | 13,141.04    | -             | -             | -              | -            | -             | 13,141.04      |
| 交易性金融资产                  |              | -5,014,500.00 | 11,719,800.00 | 47,036,226.60  | 1,991,423.20 |               | -65,761,949.80 |
| 买入返售金融资产                 | 8,000,132.00 | -             | -             | -              | -            | -             | 8,000,132.00   |
| 应收利息                     |              | -             | -             | -              | -            | 1,308,378.56  | 1,308,378.56   |
| 其他资                      |              | -             | -             | -              | -            | -             | -              |

|           |                |              |               |               |              |              |               |
|-----------|----------------|--------------|---------------|---------------|--------------|--------------|---------------|
| 产         |                |              |               |               |              |              |               |
| 资产总计      | 8,735,334.60   | 5,014,500.00 | 11,719,800.00 | 47,036,226.60 | 1,991,423.20 | 1,308,378.56 | 75,805,662.96 |
| 负债        |                |              |               |               |              |              |               |
| 卖出回购金融资产款 | 19,199,851.20  | -            | -             | -             | -            | -            | 19,199,851.20 |
| 应付管理人报酬   | -              | -            | -             | -             | -            | 33,331.86    | 33,331.86     |
| 应付托管费     | -              | -            | -             | -             | -            | 9,523.38     | 9,523.38      |
| 应付销售服务费   | -              | -            | -             | -             | -            | 165.16       | 165.16        |
| 应付交易费用    | -              | -            | -             | -             | -            | 2,110.76     | 2,110.76      |
| 应付利息      | -              | -            | -             | -             | -            | 13,274.70    | 13,274.70     |
| 应交税费      | -              | -            | -             | -             | -            | 371.27       | 371.27        |
| 其他负债      | -              | -            | -             | -             | -            | 280,000.00   | 280,000.00    |
| 负债总计      | 19,199,851.20  | -            | -             | -             | -            | 338,777.13   | 19,538,628.33 |
| 利率敏感度缺口   | -10,464,516.60 | 5,014,500.00 | 11,719,800.00 | 47,036,226.60 | 1,991,423.20 | 969,601.43   | 56,267,034.63 |

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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（2019 年 3 月 6 日）         | 上年度末（2018 年 12 月 31 日） |
|    | 利率上升 25 个基点                         | -92,153.92                  | -352,881.49            |
|    | 利率下降 25 个基点                         | 92,153.92                   | 352,881.49             |

#### 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<br>2019 年 3 月 6 日 |               | 上年度末<br>2018 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  | —                     | —             | —                        | —             |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                     | —             | —                        | —             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 13,948,578.40         | 131.01        | 65,761,949.80            | 116.87        |
| 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            | 13,948,578.40         | 131.01        | 65,761,949.80            | 116.87        |

##### 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（2019 年 3 月 6 日）         | 上年度末（2018 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准变动+5%                          | 432,321.01                  | 1,019,605.12           |
|    | 业绩比较基准变动-5%                          | -432,321.01                 | -1,019,605.12          |

#### 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（转型后）

### 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              | —            | —            |
|    | 其中：股票             | —            | —            |
| 2  | 基金投资              | —            | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 6,671,289.50 | 91.84        |
|    | 其中：债券             | 6,671,289.50 | 91.84        |
|    | 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      | 478,910.38   | 6.59         |
| 8  | 其他各项资产            | 114,195.77   | 1.57         |
| 9  | 合计                | 7,264,395.65 | 100.00       |

### 7.2 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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：无。

#### 7.2.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：无。

#### 7.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：无。

**7.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

注：无。

**7.4 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      | 1,498,800.00 | 20.70         |
| 2  | 央行票据      | -            | -             |
| 3  | 金融债券      | 2,716,894.30 | 37.53         |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,716,894.30 | 37.53         |
| 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） | 2,455,595.20 | 33.92         |
| 8  | 同业存单      | -            | -             |
| 9  | 其他        | -            | -             |
| 10 | 合计        | 6,671,289.50 | 92.16         |

**7.5 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  | 018007 | 国开 1801  | 21,890 | 2,208,044.30 | 30.50         |
| 2  | 019611 | 19 国债 01 | 15,000 | 1,498,800.00 | 20.70         |
| 3  | 018008 | 国开 1802  | 5,000  | 508,850.00   | 7.03          |
| 4  | 132005 | 15 国资 EB | 2,600  | 294,970.00   | 4.07          |
| 5  | 132015 | 18 中油 EB | 3,000  | 293,670.00   | 4.06          |

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

**7.7 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。

**7.8 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。



## 7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.9.1 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。

### 7.9.2 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。

### 7.9.3 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。

## 7.10 投资组合报告附注

### 7.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

### 7.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

### 7.10.3 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   | 3,650.66   |
| 2  | 应收证券清算款 | —          |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | 110,545.11 |
| 5  | 应收申购款   | —          |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 待摊费用    | —          |
| 8  | 其他      | —          |
| 9  | 合计      | 114,195.77 |

### 7.10.4 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  | 110046 | 圆通转债 | 231,460.00 | 3.20         |
| 2  | 113009 | 广汽转债 | 212,800.00 | 2.94         |
| 3  | 110048 | 福能转债 | 111,380.00 | 1.54         |
| 4  | 110047 | 山鹰转债 | 108,610.00 | 1.50         |

|   |        |      |           |      |
|---|--------|------|-----------|------|
| 5 | 110045 | 海澜转债 | 98,760.00 | 1.36 |
|---|--------|------|-----------|------|

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.10.6 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。

## § 7 投资组合报告（转型前）

### 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              | -             | -            |
|    | 其中：股票             | -             | -            |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 13,948,578.40 | 95.97        |
|    | 其中：债券             | 13,948,578.40 | 95.97        |
|    | 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      | 282,223.55    | 1.94         |
| 8  | 其他资产              | 304,021.64    | 2.09         |
| 9  | 合计                | 14,534,823.59 | 100.00       |

### 7.2 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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：无。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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

注：无。

#### 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

注：无。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：无。

## 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      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 13,948,578.40 | 131.01       |
|    | 其中：政策性金融债 | 13,948,578.40 | 131.01       |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 13,948,578.40 | 131.01       |

## 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  | 180212 | 18 国开 12 | 100,000 | 10,127,000.00 | 95.12        |
| 2  | 018008 | 国开 1802  | 25,000  | 2,545,000.00  | 23.90        |
| 3  | 018005 | 国开 1701  | 6,000   | 600,720.00    | 5.64         |
| 4  | 018006 | 国开 1702  | 3,760   | 383,858.40    | 3.61         |
| 5  | 018003 | 国开 1401  | 2,500   | 292,000.00    | 2.74         |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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国债期货交易情况说明****7.10.1 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。

**7.10.2 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。

**7.10.3 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。

**7.11 投资组合报告附注****7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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。

**7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

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。

**7.11.3 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   | 8,176.18   |
| 2  | 应收证券清算款 | —          |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | 295,845.46 |
| 5  | 应收申购款   | —          |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 待摊费用    | —          |
| 8  | 其他      | —          |
| 9  | 合计      | 304,021.64 |

**7.11.4 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处于转股期的可转换债券。

**7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末未持有流通受限股票。

#### 7.11.6 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（转型后）

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别           | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构 |        |              |         |
|--------------------|------------------|---------------|-------|--------|--------------|---------|
|                    |                  |               | 机构投资者 |        | 个人投资者        |         |
|                    |                  |               | 持有份额  | 占总份额比例 | 持有份额         | 占总份额比例  |
| 天 治<br>鑫 利<br>纯债 A | 113              | 61,455.37     | —     | —      | 6,944,456.26 | 100.00% |
| 天 治<br>鑫 利<br>纯债 C | 24               | 549.35        | —     | —      | 13,184.31    | 100.00% |
| 合计                 | 137              | 50,785.70     | —     | —      | 6,957,640.57 | 100.00% |

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别     | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|----------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 天治鑫利纯债 A | 3,294.64  | 0.0474%  |
|                  | 天治鑫利纯债 C | 2,887.51  | 20.9011% |
|                  | 合计       | 6,182.15  | 0.0889%  |

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

### 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的情况

| 项目           | 份额级别     | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金 | 天治鑫利纯债 A | 0~10              |

|                    |          |      |
|--------------------|----------|------|
| 投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 天治鑫利纯债 C | 0~10 |
|                    | 合计       | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金    | 天治鑫利纯债 A | 0    |
|                    | 天治鑫利纯债 C | 0    |
|                    | 合计       | 0    |



## § 8 基金份额持有人信息（转型前）

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别    | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构 |        |               |         |
|-------------|------------------|---------------|-------|--------|---------------|---------|
|             |                  |               | 机构投资者 |        | 个人投资者         |         |
|             |                  |               | 持有份额  | 占总份额比例 | 持有份额          | 占总份额比例  |
| 天 治<br>鑫利 A | 143              | 70,305.04     | —     | —      | 10,053,620.54 | 100.00% |
| 天 治<br>鑫利 C | 28               | 2,371.20      | —     | —      | 66,393.62     | 100.00% |
| 合计          | 171              | 59,181.37     | —     | —      | 10,120,014.16 | 100.00% |

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别   | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 天治鑫利 A | 4,650.34  | 0.0463%  |
|                  | 天治鑫利 C | 3,083.27  | 4.6439%  |
|                  | 合计     | 7,733.61  | 0.0764%  |

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

### 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的情况

| 项目                      | 份额级别   | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|-------------------------|--------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持 | 天治鑫利 A | 0~10              |
|                         | 天治鑫利 C | 0~10              |

|                 |        |      |
|-----------------|--------|------|
| 有本开放式基金         | 合计     | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 天治鑫利 A | 0    |
|                 | 天治鑫利 C | 0    |
|                 | 合计     | 0    |

## § 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

| 项目                                 | 天治鑫利纯债 A      | 天治鑫利纯债 C  |
|------------------------------------|---------------|-----------|
| 基金合同生效日基金份额总额                      | 10,053,620.54 | 66,393.62 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | —             | —         |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 3,109,164.28  | 53,209.31 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —             | —         |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 6,944,456.26  | 13,184.31 |

## § 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

| 项目                          | 天治鑫利 A         | 天治鑫利 C        |
|-----------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日基金份额总额               | 420,020,531.40 | 15,386,671.73 |
| 本报告期期初基金份额总额                | 53,022,778.26  | 467,411.62    |
| 本报告期期间基金总申购份额               | -              | -             |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额             | 42,969,157.72  | 401,018.00    |
| 本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"- "填列) | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                | 10,053,620.54  | 66,393.62     |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

自 2018 年 12 月 26 日至 2019 年 1 月 28 日，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。本次基金份额持有人大会于 2019 年 1 月 29 日表决通过了《关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金转型的议案》，本次大会决议自该日起生效。本基金于 2019 年 3 月 7 日转型并更名为天治鑫利纯债债券型证券投资基金，《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》自 2019 年 3 月 7 日起生效。

### 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，经工商行政管理部门核准，天治基金管理有限公司法定代表人变更为单宇先生，本基金管理人于 2019 年 3 月 23 日在中国证券监督管理委员会指定媒介及公司网站上刊登了相关公告。

报告期内，经天治基金管理有限公司第五届董事会第四十一次会议审议通过，自 2019 年 5 月 10 日起，聘任闫译文女士担任公司副总经理，上述事项已按有关规定在中国证券投资基金业协会完成相关手续，并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案，本基金管理人于 2019 年 5 月 10 日在中国证券监督管理委员会指定媒介及公司网站上刊登了相关公告。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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 2019 年 3 月 7 日转型并更名为天治鑫利纯债债券型证券投资基金，《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》同日生效。自该日起，基金投资策略变更为“本基金充分发挥基金管理人的研究优势，对宏观经济运行趋势、财政以及货币政策变化趋势作出分析和判断，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，确定本基金债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析和严格的风险控制基础上，综合考虑经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响，深入挖掘价值被低估的标的券种”。

**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（转型后）****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 |    |
| 长江证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 川财证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 光大证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东方证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东吴证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 民生证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 西南证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 西藏东方财富证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国融证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长城证券     | 3      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 安信证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中泰证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华金证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|       |   |   |   |   |   |   |
|-------|---|---|---|---|---|---|
| 东兴证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 东海证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 金元证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 爱建证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司  | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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

2、基金专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

3、本基金本报告期内租用券商交易单元的变更情况：新增渤海证券、新时代证券 2 个交易单元，退租中信证券上海、深圳各 1 个交易单元。

### 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 |            |
|------|------|-------------|--------|---------|------|------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比 | 成交金额   | 占当期债券回购 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的 |

|              |               | 例       |              | 成交总额<br>的比例 |   | 比例 |
|--------------|---------------|---------|--------------|-------------|---|----|
| 长江证券         | 22,378,581.04 | 100.00% | 7,000,000.00 | 100.00%     | - | -  |
| 兴业证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 川财证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 光大证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 华创证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 东北证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 东方证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 天风证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 东吴证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 民生证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 西南证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 西藏东方财富<br>证券 | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 国融证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 长城证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 国泰君安         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 安信证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 国信证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 国金证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 中泰证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 华金证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 东兴证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 广发证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 方正证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 招商证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 华泰证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 东海证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 金元证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 海通证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 国联证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 湘财证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 渤海证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 爱建证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 国海证券         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 申银万国         | -             | -       | -            | -           | - | -  |
| 中金公司         | -             | -       | -            | -           | - | -  |



|       |   |   |   |   |   |
|-------|---|---|---|---|---|
| 新时代证券 | - | - | - | - | - |
|-------|---|---|---|---|---|

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 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 |    |
| 长江证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 川财证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 光大证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东方证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东吴证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 民生证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 西南证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 西藏东方财富证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国融证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长城证券     | 3      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 安信证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中泰证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华金证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东兴证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 广发证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 方正证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华泰证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|       |   |   |   |   |   |   |
|-------|---|---|---|---|---|---|
| 东海证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 金元证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 爱建证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | 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、本基金本报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

### 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 |              |
|------|---------------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
|      | 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 |
| 长江证券 | 15,649,442.60 | 100.00%      | 16,400,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 兴业证券 | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 川财证券 | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 光大证券 | -             | -            | -             | -              | -    | -            |

|          |   |   |   |   |   |   |
|----------|---|---|---|---|---|---|
| 华创证券     | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券     | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券     | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券     | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券     | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券     | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券     | - | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国融证券     | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券     | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安     | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券     | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券     | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券     | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券     | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券     | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券     | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券     | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券     | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券     | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券     | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券     | - | - | - | - | - | - |
| 金元证券     | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券     | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券     | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券     | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券     | - | - | - | - | - | - |
| 爱建证券     | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券     | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国     | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司     | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券     | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券    | - | - | - | - | - | - |

**10.9 其他重大事件（转型后）**

| 序号 | 公告事项                                                  | 法定披露方式            | 法定披露日期          |
|----|-------------------------------------------------------|-------------------|-----------------|
| 1  | 天治基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告                              | 上证报、中证报、证券时报、证券日报 | 2019 年 3 月 23 日 |
| 2  | 天治旗下 11 只基金 2018 年年度报告汇总                              | 上证报、中证报、证券时报、证券日报 | 2019 年 3 月 27 日 |
| 3  | 天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金继续参加交通银行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 | 2019 年 3 月 29 日 |
| 4  | 天治旗下十一只基金 2019 年第 1 季度报告汇总                            | 上证报、中证报、证券时报、证券日报 | 2019 年 4 月 18 日 |
| 5  | 天治基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京植信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 | 2019 年 4 月 18 日 |
| 6  | 天治基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                  | 上证报、中证报、证券时报、证券日报 | 2019 年 5 月 10 日 |
| 7  | 关于天治基金管理有限公司旗下基金暂停通过浙江金观诚基金销售有限公司办理认购、申购等业务的公告        | 上证报、中证报、证券时报、证券日报 | 2019 年 6 月 11 日 |

**10.9 其他重大事件（转型前）**

| 序号 | 公告事项                              | 法定披露方式            | 法定披露日期         |
|----|-----------------------------------|-------------------|----------------|
| 1  | 封闭期内天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金周净值公告      | 上证报、证券日报          | 2019 年 1 月 2 日 |
| 2  | 天治基金管理有限公司 2018 年 12 月 31 日基金净值公告 | 上证报、中证报、证券时报、证券日报 | 2019 年 1 月 2 日 |

|    |                                                       |                   |                 |
|----|-------------------------------------------------------|-------------------|-----------------|
| 3  | 封闭期内天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金周净值公告                          | 上证报、证券日报          | 2019 年 1 月 7 日  |
| 4  | 天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的公告                       | 上证报、证券日报          | 2019 年 1 月 10 日 |
| 5  | 封闭期内天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金周净值公告                          | 上证报、证券日报          | 2019 年 1 月 14 日 |
| 6  | 天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金更新的招募说明书（摘要）（2019 年第 1 次更新）        | 上证报               | 2019 年 1 月 18 日 |
| 7  | 天治旗下十一只基金 2018 年第 4 季度报告汇总                            | 上证报、中证报、证券时报、证券日报 | 2019 年 1 月 22 日 |
| 8  | 天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金选择期开放赎回业务的公告                       | 上证报               | 2019 年 1 月 30 日 |
| 9  | 天治基金管理有限公司关于天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告  | 上证报               | 2019 年 1 月 30 日 |
| 10 | 封闭期内天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金周净值公告                          | 上证报               | 2019 年 1 月 31 日 |
| 11 | 天治基金管理有限公司旗下基金增加泰诚财富为代销机构、开通定期定额投资和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 | 2019 年 2 月 15 日 |
| 12 | 天治基金管理有限公司关于《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》生效的公告                | 上证报               | 2019 年 3 月 6 日  |
| 13 | 天治鑫利纯债债券型证券投资基金开放申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告                 | 上证报               | 2019 年 3 月 6 日  |

## § 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              | 20190115-20190115       | 7,781,128.40 | 0.00 | 7,781,128.40 | 0.00       | 0.00% |
|                                                                          | 2              | 20190115-20190117       | 9,726,653.70 | 0.00 | 9,726,653.70 | 0.00       | 0.00% |
| 产品特有风险                                                                   |                |                         |              |      |              |            |       |
| 本基金单一投资者持有的基金份额比例较高，需要保持足够好的流动性应对集中赎回情况。但本基金以流动性较好的资产为主，可及时变现，流动性风险总体可控。 |                |                         |              |      |              |            |       |

### 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鑫利纯债债券型证券投资基金募集的文件
2. 《天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金合同》
3. 《天治鑫利纯债债券型证券投资基金招募说明书》
4. 《天治鑫利纯债债券型证券投资基金托管协议》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
6. 报告期内天治鑫利纯债债券型证券投资基金公告的各项原稿

### 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

2019 年 8 月 23 日