

天治稳健双盈债券型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:天治基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天治稳健双盈债券型证券投资基金
基金简称	天治稳健双盈债券
基金主代码	350006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月05日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	640,524,023.67份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在注重资产安全性和流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。本基金将主要投资于债券资产，同时密切关注股票市场的运行状况与风险收益特征，把握相对确定性的投资机会，从而达到股票、债券双盈的目标。债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。本基金将采取“自下而上”的方式精选个股。本基金将全面考察上市公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本面特征，同时综合利用市盈率（P/E）、市净率（P/B）和折现现金流（DCF）等估值方法对公司的投资价值进行分析和比较，挖掘具备中长期持续增长的上市公司股票库，以获得较高投资回报。
业绩比较基准	中证全债指数收益率*90%+沪深300指数收益率*1

	0%
风险收益特征	本基金属于主动管理的债券型基金，为证券投资基金中的较低风险较低收益品种，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	天治基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵正中
	联系电话	021-60371155
	电子邮箱	zhaozz@chinanature.com.cn
客户服务电话	400-098-4800(免长途通话费用)、021-60374800	95599
传真	021-60374934	010-68121816
注册地址	上海市浦东新区莲振路298号4号楼231室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	上海市复兴西路159号	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200031	100031
法定代表人	单宇	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日- 2022年06月30日)
本期已实现收益	-1,011,781.33
本期利润	-3,151,250.18
加权平均基金份额本期利润	-0.0367
本期加权平均净值利润率	-2.93%
本期基金份额净值增长率	-3.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)
期末可供分配利润	149,487,872.43
期末可供分配基金份额利润	0.2334
期末基金资产净值	790,011,896.10
期末基金份额净值	1.2334
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	110.90%

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

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差	①-③	②-④

				④		
过去一个月	0.54%	0.21%	0.91%	0.11%	-0.37%	0.10%
过去三个月	-2.15%	0.46%	1.66%	0.14%	-3.81%	0.32%
过去六个月	-3.79%	0.35%	0.84%	0.15%	-4.63%	0.20%
过去一年	-0.27%	0.36%	3.28%	0.13%	-3.55%	0.23%
过去三年	6.95%	0.29%	14.33%	0.13%	-7.38%	0.16%
自基金合同生效起至今	110.90%	0.38%	77.38%	0.11%	33.52%	0.27%

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

天治稳健双盈债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2008年11月05日-2022年06月30日)



3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人—天治基金管理有限公司于2003年5月成立，注册资本1.6亿元，注册地为上海。公司股权结构为：吉林省信托有限责任公司出资9800万元，占注册资本的61.25%；中国吉林森林工业集团有限责任公司出资6200万元，占注册资本的38.75%。截至2022年6月30日，本基金管理人旗下共有十四只开放式基金，除本基金外，另外十三只基金—天治财富增长证券投资基金、天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）、天治天得利货币市场基金、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、天治可转债增强债券型证券投资基金、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金（转型自2011年12月28日生效的天治稳定收益债券型证券投资基金）、天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金（转型自2008年5月8日生效的天治创新先锋混合型证券投资基金）、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金（转型自2005年1月12日生效的天治品质优选混合型证券投资基金）、天治新消费灵活配置混合型证券投资基金（转型自2011年8月4日生效的天治成长精选混合型证券投资基金）、天治鑫利纯债债券型证券投资基金（转型自2016年12月7日生效的天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金）、天治转型升级混合型证券投资基金、天治量化核心精选混合型证券投资基金、天治天享66个月定期开放债券型证券投资基金分别于2004年6月29日、2006年1月20日、2006年7月5日、2009年7月15日、2013年6月4日、2015年6月9日、2016年4月7日、2016年4月18日、2016年7月6日、2019年3月7日、2019年5月21日、2019年6月11日、2021年09月16日生效。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王洋	公司投资副总监兼固定收益部总监、本基金基金经理、天治可转债增强债券型证券投资基金基金经理	2015-02-17	2022-01-27	14年	数量经济学硕士研究生，具有基金从业资格，曾任天治基金管理有限公司交易员、研究员、基金经理助理。
许家涵	公司投资总监兼权益投资部总监、本基金基金经理、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金经	2022-01-18	-	17年	经济学、文学双学士，具有基金从业资格。2005年7月至2007年9月就职于吉林省信托有限责任公司任

	理、天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理			自营资金部职员，2007年9月至今就职于天治基金管理有限公司，曾任交易员、交易部总监助理、交易部副总监、交易部总监。
--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人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。严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照《天治稳健双盈债券型证券投资基金基金合同》、《天治稳健双盈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。本报告期内，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

报告期内，本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国内疫情冲击、俄乌战争冲突、美联储加息缩表是影响上半年宏观经济和大类资产的重要因素。受俄乌战争冲突，美联储加息缩表和海外经济下行影响，上半年海外市场主要指数普遍下跌，美股相对跌幅较大。国内在稳增长政策不断落地、流动性宽松和经济预期改善情形下，股市走出了V型态势，上半年 A股出现了较为明显的分化行情。受俄乌冲突和供应端产量释放有限影响，油价上涨，工业品价格在海外经济下行担忧的情形下普遍下跌。美债利率大幅回升后回落，国内利率维持区间震荡状态。

上半年受疫情对需求端冲击、以及原材料和关键零部件供应链扰动影响，我国制造业PMI显著回落，投资消费和工业数据均大幅下行。基建是PMI中相对偏强的分项，建筑业活动预期指数仍处于扩张区间。受相关行业原材料采购和产品销售价格持续高位运行影响，中下游行业成本压力不断加大。国内经济下行压力加大背景下，稳增长政策密集出台，其中，4月25日国务院发布促进消费意见，4月29日中央政治局会议要求“加大宏观政策调节力度，扎实稳住经济，努力实现全年经济社会发展预期目标，保持经济运行在合理区间”，提振市场对稳增长信心并降低市场对国内经济不确定性担忧，5月国常会放宽汽车限购、阶段性减征汽车购置税。随着物流修复、疫情受影响地区逐步复工复产，5月投资、消费和工业数据均相对4月环比改善，社零降幅环比收窄，电商消费修复较快。总体来看，5月基建投资明显恢复，地产投资修复仍然偏慢。6月随着国内疫情防控取得明显成效，稳增长政策逐步落地，经济相对5月进一步改善，其中，汽车销量和地产成交量环比改善显著。往后看，随着疫情管控措施放松，经济逐步修复，国内经济下半年将维持温和回升的趋势。

上半年海外经济总体处于逐步降温的趋势，但受俄乌战争冲突、供应链扰动影响，通胀仍处于历史高位。其中，美国CPI在5月份同比8.6%，通胀再创年内新高，超市场预期，能源和食品是推动通胀上行的主要因素。6月美联储议息会议加息75BP，是1994年以来单次最大幅度的加息，缩表如期进行，美联储强调控制通胀的决心，并大幅下调2022年和2023年经济增长预期。美国制造业PMI年初以来处于逐步下行的趋势，密歇根消费者信心指数大幅下行，房贷利率不断上行的背景下地产销售逐步降温，流动性逐步收紧叠加经济降温是美国经济当前的主要特征，也是导致美股持续下跌的主要因素。金融条件逐步收紧的情形下，市场对美国经济衰退的担忧也逐步升温，美债利率从接近3.5%的高点逐步回落。往后看，经济下行背景下CRB商品指数同比预计维持下行趋势，美国消费者通胀预期也将逐步回落。

从权益市场来看，上半年由于国内疫情肆虐，尤其以上海为主要城市地区的疫情加剧，城市运转停滞，经济受阻，股市一度大幅下挫，尤其是以成长股为代表的创业板跌幅较大。但在4月底，市场对政府刺激经济的预期已经一致，叠加成长股的估值已经跌

至底部，市场抄底资金蜂拥而至，又是以成长股为核心的新能源、汽车、半导体等板块大幅反弹，上涨趋势延续至二季度末。

在以上的宏观市场环境下，本基金在债券投资方面有所调整，久期由长变短，以利率债配置为主，保持相对安全的久期，规避利率大幅上行的风险。权益组合方面，主要目标为获取稳健的绝对收益回报，与此同时，配置具有长期投资价值的低估品种，以期获取价值修复的投资回报。

本基金旨在追求通过资产的有效配置为基金持有人获取稳健可持续回报，在资产配置上更看重相关品种的安全边际。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末天治稳健双盈债券基金份额净值为1.2334元，本报告期内，基金份额净值增长率为-3.79%，同期业绩比较基准收益率为0.84%，低于同期业绩比较基准收益率4.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内在流动性相对宽松、稳增长政策落地的背景下，经济预计将处于温和修复的趋势，但在地产信用风险扰动、消费场景受限、疫情影响下居民收入持续受到冲击的情形下，本轮国内经济修复的强度预计显著弱于2020年疫情后的反弹。下半年国内CPI预计维持上行趋势，但在需求偏弱、核心CPI低迷，外部面临输入性通胀压力情形下，央行货币政策预计仍将维持相对宽松，并兼顾长期与短期、经济增长和物价稳定、内部均衡和外部均衡。从外部因素来看，通胀压力下美国加息缩表将导致经济逐步由降温向衰退周期转换，外需对我国经济拉动的影响将逐步减弱，但我国制造业相对完备的产业链优势以及成本优势，叠加欧洲能源危机导致供给受限将直接或间接拉动我国出口需求，预计下半年我国出口增速将处于缓慢下行趋势。随着美国经济回落、美债下行以及美联储从鹰派向鸽派转换，美联储加息对国内货币政策掣肘也将减少。

证券市场方面，上半年影响A股市场的几大因素均有所缓解，例如俄乌冲突的影响已经逐渐钝化，新冠疫情下半年虽然预计仍然会零星散发，但国家疫情防控政策已经逐步趋于宽松，稳增长、保经济的基调十分明显，此外，美联储加息对国内货币政策掣肘也逐步减弱，因此，下半年A股市场利空因素并不明显，预计三季度仍处于估值的进一步修复期。随着各行业盈利的逐步修复，市场可能会在四季度进入估值切换期。在此期间，稳增长业绩兑现和“专精特新”逐渐占优。具体来看，重点关注并看好的行业包括：① 本轮商品周期由供给侧主导，制造业前期遭受较大冲击，在后期成本见顶回落、利润率快速修复的过程中，建议重点关注受益程度最高的优势制造，例如渗透率持续提升、智能化和国产化趋势不断加速的智能汽车产业链，内外需共振、业绩高增长更为确定的光伏和风电，具有国产替代率不断提升、自主可控长逻辑的半导体，以及经营改善、业

绩持续兑现的军工等。②消费板块重点关注两条主线，一是前期疫情受损行业的修复，包括航空、酒店、餐饮旅游；二是在局部疫情背景下仍然维持高景气的细分行业，包括白酒、户外用品、美妆产业链。③医药行业受政策影响缓和，或迎来阶段性估值修复行情，重点关注创新药、医疗器械、CXO、医疗服务。④主题方面，下半年建议关注国企改革、精密制造出海等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人的基金估值和会计核算由基金结算部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制。基金会计均具备基金从业资格。为确保基金资产估值的公平、合理、合规，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了天治基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了有关议事规则。估值委员会成员包括公司投资决策委员会成员、负责基金结算的管理层、监察稽核部总监、产品开发与金融工程部总监等，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对于权益投资部、量化投资部、固定收益部以及产品开发与金融工程部提交的估值模型和估值结果进行论证审核，并签署最终意见。基金经理会参与估值，与产品开发与金融工程部一同根据估值模型、估值程序计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，将估值结果提交公司估值委员会。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。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，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-天治基金管理有限公司2022年1月1日至2022年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，天治基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天治稳健双盈债券型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,905,793.37	943,153.32
结算备付金		5,332,221.90	102,360.09
存出保证金		25,896.20	8,244.98
交易性金融资产	6.4.7.2	782,219,657.35	83,664,009.46
其中：股票投资		-	13,108,386.80
基金投资		-	-
债券投资		782,219,657.35	70,555,622.66

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,530.00	10,630.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	976,486.16
资产总计		790,485,098.82	85,704,884.01
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		11,572.36	21,393.96
应付管理人报酬		119,906.81	50,005.24
应付托管费		34,259.09	14,287.20
应付销售服务费		51,388.62	21,430.82

应付投资顾问费		-	-
应交税费		551.26	375.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	255,524.58	155,078.78
负债合计		473,202.72	262,571.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	640,524,023.67	66,649,320.39
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	149,487,872.43	18,792,992.38
净资产合计		790,011,896.10	85,442,312.77
负债和净资产总计		790,485,098.82	85,704,884.01

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额净值1.2334元，基金份额总额640,524,023.67份。

6.2 利润表

会计主体：天治稳健双盈债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-2,417,701.28	1,553,723.44
1. 利息收入		53,709.13	588,967.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	51,400.90	5,156.88
债券利息收入		-	583,810.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,308.23	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-332,629.31	2,571,856.00
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,021,480.53	1,506,330.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2,560,585.94	989,332.55
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	128,265.28	76,192.47
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,139,468.85	-1,607,393.16
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	687.75	292.97
减：二、营业总支出		733,548.90	623,206.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	359,899.63	232,348.29
2. 托管费	6.4.10.2. 2	102,828.49	66,385.19
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	154,242.66	99,577.88
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		39,518.17	110,557.54
其中：卖出回购金融资产 支出		39,518.17	110,557.54
6. 信用减值损失		-	-

7. 税金及附加		148.59	381.14
8. 其他费用	6.4.7.18	76,911.36	113,956.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,151,250.18	930,517.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,151,250.18	930,517.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,151,250.18	930,517.16

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天治稳健双盈债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	66,649,320.39	-	18,792,992.38	85,442,312.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	66,649,320.39	-	18,792,992.38	85,442,312.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	573,874,703.28	-	130,694,880.05	704,569,583.33
（一）、综合收益总额	-	-	-3,151,250.18	-3,151,250.18

(二)、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)	573,874,703.28	-	133,846,130.23	707,720,833.51
其中: 1. 基金申购款	578,148,392.74	-	134,937,580.25	713,085,972.99
2. 基金赎回款	-4,273,689.46	-	-1,091,450.02	-5,365,139.48
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	640,524,023.67	-	149,487,872.43	790,011,896.10
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	70,248,136.86	-	15,444,889.98	85,693,026.84
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	70,248,136.86	-	15,444,889.98	85,693,026.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-18,379,685.38	-	-3,169,476.14	-21,549,161.52
(一)、综合收益总	-	-	930,517.16	930,517.16

额				
(二)、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)	-18,379,685.38	-	-4,099,993.30	-22,479,678.68
其中: 1. 基金申购款	1,520,360.59	-	352,402.61	1,872,763.20
2. 基金赎回款	-19,900,045.97	-	-4,452,395.91	-24,352,441.88
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	51,868,451.48	-	12,275,413.84	64,143,865.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

徐克磊

闫译文

黄宇星

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天治稳健双盈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[2008]817号文《关于核准天治稳健双盈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业募集,基金合同于2008年11月5日正式生效,首次设立募集规模为787,576,971.03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及注册登记机构为天治基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、

公司债（含非公开发行公司债）、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、国债期货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）

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。

本基金的业绩比较基准为中证全债指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年06月30日的财务状况以及2022年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的

额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

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

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币943,153.32元，自应收利息转入的重分类金额为人民币143.24元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币943,296.56元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币102,360.09元，自应收利息转入的重分类金额为人民币46.10元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币102,406.19元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币8,244.98元，自应收利息转入的重分类金额为人民币3.70元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币8,248.68元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币976,486.16元，转出至银行存款的重分类金额为人民币143.24元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币46.10元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币3.70元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币976,293.12元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币83,664,009.46元，自应收利息转入的重分类金额为人民币976,293.12元。经上述重分类后，交易性金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币84,640,302.58元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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. 印花税

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

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

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

2. 增值税

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

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增

值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

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

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

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

5. 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
----	--------------------

活期存款	2,905,793.37
等于：本金	2,869,080.45
加：应计利息	36,712.92
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,905,793.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	57,400,195.02	1,152,339.81	58,517,134.51	-35,400.32
	银行间市场	710,882,970.00	12,849,522.84	723,702,522.84	-29,970.00
	合计	768,283,165.02	14,001,862.65	782,219,657.35	-65,370.32

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	768,283,165.02	14,001,862.65	782,219,657.35	-65,370.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.95
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	188,705.15
其中：交易所市场	184,627.15
银行间市场	4,078.00
应付利息	-
信息披露费	39,671.58
审计费	17,356.09

其他	9,790.81
合计	255,524.58

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	66,649,320.39	66,649,320.39
本期申购	578,148,392.74	578,148,392.74
本期赎回（以“-”号填列）	-4,273,689.46	-4,273,689.46
本期末	640,524,023.67	640,524,023.67

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	17,175,933.55	1,617,058.83	18,792,992.38
本期利润	-1,011,781.33	-2,139,468.85	-3,151,250.18
本期基金份额交易产生的变动数	137,300,424.69	-3,454,294.46	133,846,130.23
其中：基金申购款	138,412,540.88	-3,474,960.63	134,937,580.25
基金赎回款	-1,112,116.19	20,666.17	-1,091,450.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	153,464,576.91	-3,976,704.48	149,487,872.43

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
	活期存款利息收入
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	8,018.99
其他	124.91
合计	51,400.90

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	104,642,913.18
减：卖出股票成本总额	107,358,177.07
减：交易费用	306,216.64
买卖股票差价收入	-3,021,480.53

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	1,256,136.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,304,449.72
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	2,560,585.94

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股）	62,397,722.26

及债券到期兑付) 成交总额	
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	60,357,842.45
减：应计利息总额	731,080.53
减：交易费用	4,349.56
买卖债券差价收入	1,304,449.72

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.11.4 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。

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期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。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	128,265.28
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	128,265.28

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-2,139,468.85
——股票投资	-676,045.31
——债券投资	-1,463,423.54
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,139,468.85

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	687.75
合计	687.75

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,283.69
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	76,911.36

6.4.7.19 分部报告

注：无。

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
中国农业银行股份有限公司	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

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 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至202 2年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	359,899.63	232,348.29
其中：支付销售机构的客户维护费	99,015.52	78,292.59

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 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	102,828.49	66,385.19

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托管人，若遇法定节假日、休息日，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 2022年01月01日至2022年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
天治基金管理有限公司	62,668.19
中国农业银行股份有限公司	37,425.61
合计	100,093.80
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
天治基金管理有限公司	11,553.26
中国农业银行股份有限公司	34,376.45
合计	45,929.71

注：本基金销售服务费用用于本基金的销售与基金份额持有人服务等。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金销售服务费

E为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。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，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划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	2,905,793.37	43,257.00	144,936.54	3,354.65

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末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

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,905,793.37	-	-	-	-	-	2,905,793.37
结算备付金	5,332,221.90	-	-	-	-	-	5,332,221.90
存出保证金	25,896.20	-	-	-	-	-	25,896.20
交易性金融资产	-	171,889,310.40	583,786,049.66	26,544,297.29	-	-	782,219,657.35
应收申购款	-	-	-	-	-	1,530.00	1,530.00
资产总计	8,263,911.47	171,889,310.40	583,786,049.66	26,544,297.29	-	1,530.00	790,485,098.82
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,572.36	11,572.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	119,906.81	119,906.81
应付托管费	-	-	-	-	-	34,259.09	34,259.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-	51,388.62	51,388.62
应交税费	-	-	-	-	-	551.26	551.26
其他负债	-	-	-	-	-	255,524.58	255,524.58
负债总计	-	-	-	-	-	473,202.72	473,202.72
利率敏感度缺口	8,263,911.47	171,889,310.40	583,786,049.66	26,544,297.29	-	-471,672.72	790,011,896.10
上年度末 2021 年 12 月 31	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日							
资产							
银行存款	943,153.32	-	-	-	-	-	943,153.32
结算备付金	102,360.09	-	-	-	-	-	102,360.09
存出保证金	8,244.98	-	-	-	-	-	8,244.98
交易性金融资产	-	2,995,720.80	29,049,905.06	34,789,998.30	3,719,998.50	13,108,386.80	83,664,009.46
应收利息	-	-	-	-	-	976,486.16	976,486.16
应收申购款	-	-	-	-	-	10,630.00	10,630.00
资产总计	1,053,758.39	2,995,720.80	29,049,905.06	34,789,998.30	3,719,998.50	14,095,502.96	85,704,884.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	21,393.96	21,393.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,005.24	50,005.24
应付托管费	-	-	-	-	-	14,287.20	14,287.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-	21,430.82	21,430.82
应付交易费用	-	-	-	-	-	30,272.87	30,272.87
应交税费	-	-	-	-	-	375.24	375.24
其他负债	-	-	-	-	-	124,805.91	124,805.91
负债总计	-	-	-	-	-	262,571.24	262,571.24
利率敏感度缺口	1,053,758.39	2,995,720.80	29,049,905.06	34,789,998.30	3,719,998.50	13,832,931.72	85,442,312.77

注：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	上年度末

		2022年06月30日	2021年12月31日
	利率上升25个基点	-798,796.85	-231,504.80
	利率下降25个基点	798,796.85	231,504.80

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 2022年06月30日		上年度末 2021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	-	-	13,108,386.80	15.34
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	782,219,657.35	99.01	70,555,622.66	82.58
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	782,219,657.35	99.01	83,664,009.46	97.92

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	-	10,564,198.99
	业绩比较基准变动-5%	-	-10,564,198.99

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	-	37,484,602.66
第二层次	782,219,657.35	46,179,406.80
第三层次	-	-
合计	782,219,657.35	83,664,009.46

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	782,219,657.35	98.95
	其中：债券	782,219,657.35	98.95
	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	8,238,015.27	1.04
8	其他各项资产	27,426.20	0.00
9	合计	790,485,098.82	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601899	紫金矿业	4,633,083.00	5.42
2	000630	铜陵有色	3,253,744.00	3.81
3	600497	驰宏锌锗	3,087,322.00	3.61
4	002714	牧原股份	2,936,855.00	3.44
5	000656	金科股份	2,726,196.00	3.19
6	603993	洛阳钼业	2,263,559.00	2.65
7	000933	神火股份	2,146,675.00	2.51
8	300390	天华超净	2,072,718.00	2.43
9	000960	锡业股份	2,066,278.00	2.42
10	000568	泸州老窖	2,001,205.00	2.34
11	600519	贵州茅台	1,999,173.00	2.34
12	603816	顾家家居	1,954,060.00	2.29

13	002460	赣锋锂业	1,919,129.00	2.25
14	002821	凯莱英	1,913,036.00	2.24
15	600882	妙可蓝多	1,804,597.00	2.11
16	000807	云铝股份	1,775,999.00	2.08
17	300498	温氏股份	1,758,969.00	2.06
18	600267	海正药业	1,748,650.00	2.05
19	601888	中国中免	1,690,339.00	1.98
20	600988	赤峰黄金	1,648,739.00	1.93

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	6,120,230.00	7.16
2	601899	紫金矿业	4,642,885.00	5.43
3	600009	上海机场	3,794,297.60	4.44
4	000630	铜陵有色	3,295,458.00	3.86
5	600497	驰宏锌锗	3,244,318.00	3.80
6	002714	牧原股份	2,747,671.80	3.22
7	000933	神火股份	2,327,520.00	2.72
8	603993	洛阳钼业	2,311,805.00	2.71
9	300390	天华超净	2,265,224.00	2.65
10	000960	锡业股份	2,002,783.00	2.34
11	000568	泸州老窖	1,981,319.00	2.32
12	000656	金科股份	1,948,405.00	2.28
13	603816	顾家家居	1,919,260.00	2.25
14	002460	赣锋锂业	1,854,564.61	2.17
15	603899	晨光股份	1,820,925.00	2.13
16	600882	妙可蓝多	1,806,051.00	2.11

17	000807	云铝股份	1,801,142.00	2.11
18	600988	赤峰黄金	1,734,092.98	2.03
19	002821	凯莱英	1,711,643.00	2.00
20	601888	中国中免	1,708,635.00	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	94,925,835.58
卖出股票收入（成交）总额	104,642,913.18

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	50,446,510.76	6.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	600,718,606.00	76.04
	其中：政策性金融债	600,718,606.00	76.04
4	企业债券	2,150,742.90	0.27
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	128,903,797.69	16.32
9	其他	-	-
10	合计	782,219,657.35	99.01

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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净
---	------	------	-------	------	--------

号					值比例 (%)
1	170212	17国开12	2,000,000	207,612,931.51	26.28
2	150221	15国开21	1,300,000	133,937,147.95	16.95
3	2203680	22进出680	1,300,000	129,472,708.70	16.39
4	120249	12国开49	500,000	51,844,027.40	6.56
5	190308	19进出08	500,000	51,307,493.15	6.49

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国进出口银行在报告编制日前一年内曾

受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、国家外汇管理局浙江省分局的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、国家市场监督管理总局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行、国家外汇管理局福建省分局的处罚。

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	25,896.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,530.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,426.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,502	182,902.35	598,091,974.29	93.38%	42,432,049.38	6.62%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	365.80	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年11月05日)基金份额总额	787,576,971.03
本报告期期初基金份额总额	66,649,320.39
本报告期基金总申购份额	578,148,392.74
减：本报告期基金总赎回份额	4,273,689.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	640,524,023.67

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
川财证券	1	65,852,455.33	33.00%	60,182.94	32.64%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	9,265,204.00	4.64%	8,443.33	4.58%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

民生证券	1	9,865,252.00	4.94%	9,070.19	4.92%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	114,585,837.43	57.42%	106,714.45	57.87%	-
中山证券	2	-	-	-	-	-

注：1、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、报告期内本基金无租用券商交易单元变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	8,563,940.26	9.53%	-	-	-	-	-	-
华西证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
民生证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国 际	81,308,198. 41	90.47%	151,100,000. 00	100.00%	-	-	-	-
中山证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天治基金管理有限公司关于公司旗下基金产品执行新金融工具会计准则的公告	中国证监会指定媒介	2022-01-05
2	天治稳健双盈债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2022-01-18
3	天治稳健双盈债券型证券投资基金更新的招募说明书	中国证监会指定媒介	2022-01-19
4	天治稳健双盈债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2022-01-19
5	天治基金管理有限公司旗下基金2021年第4季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-01-21
6	天治稳健双盈债券型证券投资基金2021年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2022-01-21
7	天治稳健双盈债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2022-01-27
8	天治稳健双盈债券型证券投资基金更新的招募说明书	中国证监会指定媒介	2022-01-28
9	天治稳健双盈债券型证券投资基金基金产品资料概要更	中国证监会指定媒介	2022-01-28

	新		
10	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加攀赢基金为代销机构、开通定期定额投资业务和基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2022-02-25
11	天治基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在同花顺基金最低申购金额, 最低赎回、转换、持有份额的公告	中国证监会指定媒介	2022-03-07
12	天治基金管理有限公司旗下基金2021年年度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-03-25
13	天治稳健双盈债券型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会指定媒介	2022-03-25
14	天治基金管理有限公司旗下基金增加中植基金为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2022-03-25
15	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加广发证券基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2022-03-30
16	天治基金管理有限公司关于调整旗下部分基金所持新五丰股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2022-04-19
17	天治基金管理有限公司关于调整旗下部分基金所持“新五丰”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2022-04-19
18	天治稳健双盈债券型证券投资基金2022年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2022-04-21
19	天治基金管理有限公司旗下	中国证监会指定媒介	2022-04-21

	基金2022年第1季度报告提示性公告		
20	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加西部证券定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2022-04-25
21	天治稳健双盈债券型证券投资基金更新的招募说明书	中国证监会指定媒介	2022-04-27
22	天治稳健双盈债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2022-04-27
23	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加西部证券基金申购手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2022-06-14
24	天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加申万宏源证券、申万宏源西部证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2022-06-20
25	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加腾安基金为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2022-06-28

§ 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	20220101-20220615	15,922,299.18	24,323,009.57	0.00	40,245,308.75	6.28%
	2	20220621-20220623	0.00	40,551,500.41	0.00	40,551,500.41	6.33%
	3	20220624-20220630	0.00	162,153,397.11	0.00	162,153,397.11	25.32%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在持有基金份额超过20%的持有人，存在持有人大额赎回带来的流动性风险。根据份额持有人的结构							

和特点，本基金的投资组合已经根据其可能产生的流动性风险作出相应调整，现有投资组合中流动性较好的资产比例较高，20%以上份额持有人的大额赎回对本基金的流动性影响有限。

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稳健双盈债券型证券投资基金募集的文件
2. 《天治稳健双盈债券型证券投资基金基金合同》
3. 《天治稳健双盈债券型证券投资基金托管协议》
4. 《天治稳健双盈债券型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内天治稳健双盈债券型证券投资基金公告的各项原稿

12.2 存放地点

天治基金管理有限公司办公地点-上海市复兴西路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

天治基金管理有限公司
二〇二二年八月三十日