

# 天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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:2023 年 03 月 24 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2023年3月21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。

本报告期自2022年1月1日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 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	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
8.6 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	73
8.7 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	73
8.8 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	73
8.9 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	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	73

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	73
8.12 投资组合报告附注.....	73
§9 基金份额持有人信息.....	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	74
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	75
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	75
§10 开放式基金份额变动.....	75
§11 重大事件揭示.....	75
11.1 基金份额持有人大会决议.....	76
11.2 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.....	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
11.4 基金投资策略的改变.....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
11.8 其他重大事件.....	80
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
12.1 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.....	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§13 备查文件目录.....	84
13.1 备查文件目录.....	84
13.2 存放地点.....	84
13.3 查阅方式.....	84

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	天治核心成长混合（LOF）
场内简称	天治核心LOF
基金主代码	163503
交易代码	163503
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2006年01月20日
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	626,191,168.43份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年07月30日

### 2.2 基金产品说明

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

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	天治基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵正中
	联系电话	021-60371155
	电子邮箱	zhaozz@chinanature.com.cn
客户服务电话	400-098-4800（免长途通话费用）、021-60374800	95559
传真	021-60374934	021-62701216
注册地址	上海市徐汇区丰谷路315弄24号1-3层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址	上海市复兴西路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	马铁刚	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼

注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街17号恒奥中心A座
--------	----------------	---------------------

### §3 主要财务指标、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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022年	2021年	2020年
本期已实现收益	-160,943,265.50	107,902,572.59	187,041,058.90
本期利润	-164,965,870.49	46,853,199.41	215,159,019.76
加权平均基金份额本期利润	-0.2632	0.0668	0.2284
本期加权平均净值利润率	-43.90%	9.34%	37.95%
本期基金份额净值增长率	-34.46%	8.61%	46.81%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	-7,331,504.60	157,749,019.11	157,574,219.21
期末可供分配基金份额利润	-0.0117	0.2517	0.1910
期末基金资产净值	313,579,555.23	478,989,386.88	580,412,928.85
期末基金份额净值	0.5008	0.7641	0.7035
3.1.3 累计期末指标	2022年末	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	152.69%	285.54%	254.97%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.74%	1.41%	1.95%	0.86%	-8.69%	0.55%
过去六个月	-20.42%	1.37%	-8.73%	0.80%	-11.69%	0.57%
过去一年	-34.46%	1.65%	-15.15%	0.98%	-19.31%	0.67%
过去三年	4.51%	1.85%	6.78%	0.95%	-2.27%	0.90%
过去五年	0.10%	1.67%	4.12%	0.96%	-4.02%	0.71%
自基金合同生效起至今	152.69%	1.68%	269.99%	1.26%	-117.30%	0.42%

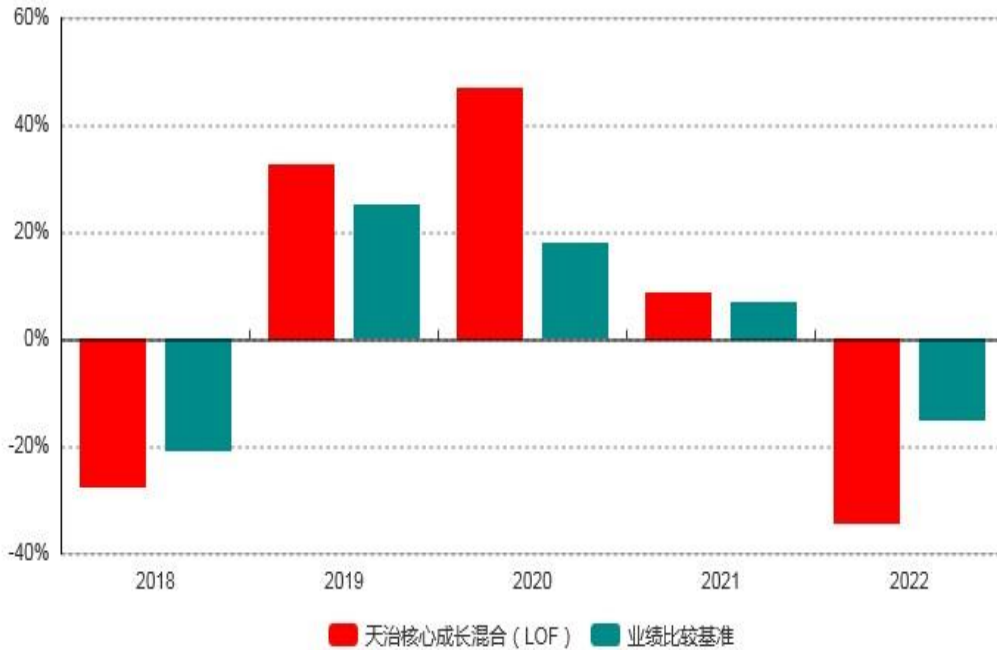
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2006年01月20日-2022年12月31日)



#### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## §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12月31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、天治天得利货币市场基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、天治可转债增强债券型证券投资基金、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金（转型自2011年12月28日生效的天治稳定收益债券型证券投资基金）、天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金（转型自2008年5月8日生效的天治创新先锋混合型证券投资基金）、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金（转型自2005年1月12日生效的天治品质优选混合型证券投资基金）、天治新消费灵活配置混合型证券投资基金（转型自2011年8月4日生效的天治成长精选混合型证券投资基金）、天治鑫利纯债债券型证券投资基金（转型自2016年12

月7日生效的天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金）、天治转型升级混合型证券投资基金、天治量化核心精选混合型证券投资基金、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7月5日、2008年11月5日、2009年7月15日、2013年6月4日、2015年6月9日、2016年4月7日、2016年4月18日、2016年7月6日、2019年3月7日、2019年5月21日、2019年6月11日、2021年9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		
许家涵	公司投资总监兼权益投资部总监、本基金基金经理、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天治稳健双盈债券型证券投资基金基金经理	2015-06-02	-	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遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定制定了公司《公平交易制度》。公司公平交易体系涵盖研究分析、授权、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，各环节公平措施简要如下：

公司的内外部报告均通过统一的研究管理平台发布，所有的研究员和投资组合经理均有权通过该平台查看公司所有内外部研究报告。

投资组合经理在授权权限范围内做出投资决策，并负责投资决策的具体实施。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。同时，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度。并在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，交易系统将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合。

公司对银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

公司对银行间市场交易价格异常的控制采用事前审查的方法。回购利率异常指回购利率偏离同期公允回购利率30bp以上；现券交易价格异常指根据交易价格推算出的收益率偏离同期公允收益率30bp以上（一年期以上债券为50bp），其中，货币基金的现券交易价格异常指根据交易价格推算出的收益率偏离同期公允收益率30bp以上。

公司风控人员定期对各投资组合进行业绩归因分析，并于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内，不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。

具体方法如下：

- 1) 对不同投资组合，根据不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）的每个券种，计算其交易均价；
- 2) 对一段时间（季度或年度）同一时间窗口的同个券种进行匹配，计算出价差率；
- 3) 利用统计方法对多个价差率进行统计分析，分析价差率是否显著大于0。如果某一资产类别观测期间样本数据太少，则不进行统计检验，仅检查对不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）的价差率是否超过阈值；

4) 价差率不是显著大于0的，则不能说明非公平交易；价差率显著大于0的，则需要综合其他因素做出判断，比如交易占优势的投资组合是否收益也显著大于交易占劣势的投资组合。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

#### 4.3.3 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

宏观方面，2022年疫情防控成为国内最重要的政策之一。由于二季度上海、北京、广州等经济体量占比高的城市疫情相继爆发，导致国内经济增长动能出现大幅下滑。进入下半年以来，疫情防控政策开始逐步优化，相继出台了“二十条”、“新十条”等重磅政策。财政政策方面，2022年提升积极的财政政策效能，虽然赤字率回归到2.8%，专项债规模持平3.65万亿，但在央行上缴利润等支持下，实际赤字率远超预期，政策性金融等准财政政策发力。货币政策方面，2022年，在国内房地产下行、海外俄乌冲突、美联储加息等多重冲击下，央行选择“加大稳健的货币政策实施力度”，实际效果是宽松并以内为主。

出口方面，2022年外需回落压力逐渐显现，出口数量逐渐走弱；但俄乌冲突之下，全球能源和电力成本上升，我国的成本优势和产业链优势支撑出口份额，新能源、天然气、汽车等供给优势产品出口增加，呈现衰退式顺差。

投资方面，逆周期调节压力大，基建投资高速增长；房地产供需两端相互抑制形成恶性循环。房企端，外源融资和销售回款不足→开工拿地受阻+施工放缓+竣工困难；居民端，就业和收入不稳+房价预期不强+对交房有担忧→购房需求降低+提前还贷形成资产负债表衰退现象，销售、拿地、开工、施工、竣工全线低迷；制造业投资维持韧性，与订单、产能、库存和盈利的周期表征似乎有所背离，主要的原因在于基数低+退税和金融支持+出口韧性+产能迁入。

消费方面，受疫情影响，消费意愿和消费场景等多因素限制消费恢复。当下较低收入群体面临的制约主要是消费能力和消费意愿，一方面，失业率面临周期扰动，可支配收入增速降低影响消费能力；另一方面，不确定性使得预防性储蓄增多，影响消费意愿。

较高收入群体面临的制约主要是消费场景，场景不足使得消费倾向被动降低以及储蓄被动增加。

市场层面，2022年A股市场波动加剧，整体下行，上证综指全年跌幅15.1%。市场表现疲弱的背后是来自海内外多个因素的压制：海外俄乌冲突推升全球通胀和欧洲能源危机、美联储激进加息导致全球金融环境收紧，国内疫情反复冲击、经济下行压力加大、多地房贷断供引发地产信用风险、以及台海地缘政治危机冲击中美关系等。市场风格来看，价值优于成长，风格轮动加速。代表价值的上证50全年跌19.5%，优于代表成长的创业板指跌29.4%；代表大盘的中证100跌22.1%，与代表小盘的中证1000跌幅21.6%接近。全年风格轮动迅速，市场整体下行，防御性情绪占据主导阶段，大盘价值整体表现较好；4月底-7月初中小成长行情占优，主要由稳增长政策出台、剩余流动性宽松驱动。

基金操作层面，聚焦核心资产，根据产品设计对资产配置的要求，上半年，本基金继续执行了大、小盘个股相对均衡配置的核心-卫星策略。配置方向上，一季度重点布局受益涨价的大宗商品、新能源产业链、农产品以及“稳增长”链条，在一、二月取得了较好的表现；但国内疫情爆发后，四月市场快速下跌过程中，一季度表现较好的工业金属、生猪养殖板块出现深度回调，拖累组合净值回撤较大。二、三季度，随着复工复产的提速，特别是汽车消费刺激政策的持续落地，本基金重点配置汽车产业链，重点聚焦整车、零部件、汽车电子、汽车智能化、上游原材料、中游电池等环节，净值出现明显回升。四季度，伴随着“二十大”的胜利召开和防疫政策的改变，本基金围绕“发展”、“安全”以及疫后复苏，重点布局数字经济、半导体、新能源、医药、食品饮料、家电、大金融等方向。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末天治核心成长混合（LOF）基金份额净值为0.5008元，本报告期内，基金份额净值增长率为-34.46%，同期业绩比较基准收益率为-15.15%，低于同期业绩比较基准收益率19.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面，消费是2023年可以期待的变量。一是，空间上，消费连续三年修复不足、无论从基数上还是压抑的消费需求上本就有空间；二是，消费能力上有望边际修复，失业率、收入等顺周期变量均有望受益于内需修复。居民部门积累下一定的超额预防性储蓄和被动储蓄，9月央行例会又提及“降低消费贷成本”，内源的收入与储蓄、外源的借贷成本都为后续消费能力提供潜在支撑；三是，防疫政策全面放开后，消费场景边际恢复，不确定性降低推升消费意愿。

投资方面，房产需求还在，只不过被压制了。过去一年供需两端政策组合拳陆续推出，尤其在2022年11月以来，供给端政策加速推进。保交楼纾困资金陆续落地，信贷、

债券、股权等融资支持工具“三箭齐发”，行业融资环境边际改善，整体地产信用违约风险显著改善。

海外方面，2023年美联储或将结束加息。一方面，除服务业分项外，美国CPI其他分项已见拐点，美国通胀预期将显著回落。另一方面，美国生产和消费或将进入下行周期，经济衰退压力将迫使美联储结束加息。汇率方面，一般来讲，海外收紧、国内宽松的货币环境下，人民币贬值压力较大，而随着2023年美国通胀走弱、美联储加息预期放缓，美元指数或将见顶回落，人民币贬值压力也将边际减弱。

2023年市场展望：

我们认为，随着防疫、地产政策的改变，带来经济复苏预期，当前市场已经构筑中期底部，向下空间有限，而随着经济逐步企稳、向上，A股估值有望向上修复。

根据本基金合同投向要求，结合宏观政策研判，我们重点关注符合二十大和十四五规划政策导向的行业，包括：计算机、半导体、基础零部件、新能源、航空航天、工业母机等。

其中，重点关注与数字经济领域相关度较高的计算机板块，理由如下：通过深度学习20大报告，我们认为“发展”和“安全”是2023年两条重要的主线，而数字经济是这两方面的结合体，因此，本基金将重点配置数字经济方向。

数字经济除了改善传统产业的运营效率，更大的核心其实在于，数据资产改善政府、国企报表结构，远期替代房地产成为新的增长曲线，也是政府促进经济的新抓手。数字经济是要发展，信创推动是要安全，我国未来技术创新肯定会持续坚持并且平衡好发展和安全两个方向。产业数字化、数字产业化是数字经济的重要内容，其中推动数字技术与实体经济深度融合是数字经济发展的主线。高质量发展一定会提到数字化趋势，这是必然的方向，未来也一定会从政府主导市场，逐步会变成自发性、长期、持续、稳定、良性的行业趋势性发展。

综上，我们认为，计算机板块在2023年将迎来业绩+政策双轮驱动的行市。在细分赛道的选择上，我们看好：1）信创行业：2023年国产化有望进入常态化招标阶段，招标范围有望较以前扩大数倍，带动基础软硬件和应用软件市场进入第二成长曲线。2）数据安全行业：数据生存周期里面各个阶段包括采集、存储、传输等都需要数据安全技术作为基石，技术要求和价格逐年提升；3）金融IT每年费用开支比例在逐年提升，税务IT和财政IT建设也将迎来新基建规划，金税四期和预算一体化对财税体系的建设带来更多新的挑战的建设需求，相关公司也会受益；4）新颁布的数据要素20条和数据资源入表的政策发布，明确划分了个人数据、政府数据和公共数据，同时也允许数据有偿交易以及数据资源入资产表，能够极大降低相关公司费用提升利润率。未来随着数据确权、数据交易的更多相关法律政策落地，将会迎来更加活跃的市场发展，利好参与相关环节的公司。5）以ChatGPT为代表的新一轮人工智能发展浪潮。

另外，本基金也将重点关注近两年经过持续调整的医药板块的投资机会，长期来看，医药赛道“长坡厚雪”的本质并未改变，随着医药“集采”所带来的存量优化，或将倒逼相关企业品质升级，从而推动医药行业整体的升级发展，行业成长依旧可期，2023年存在估值修复的潜力。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022年，本基金管理人持续依照法律法规规定和公司内控制度要求独立开展监察稽核工作，通过现场检查、系统实时监控、人员询问、重点抽查等方式，监督本基金运作相关的内控制度建设及各项制度执行情况，内容包括但不限于投资组合的投资研究、投资决策、交易执行和投资风险、绩效评估等情况、产品研发流程、基金销售、宣传推介、客户服务、信息技术日常处理及其安全情况、基金结算及人事管理等业务环节。

本基金管理人内部监察稽核发现：

一、报告期内，本基金管理人持续更新、完善了内部控制体系，制定或修订了多项内部控制制度，有效保障了公司相关机构职能的发挥及业务的发展，本基金管理人的内部控制体系覆盖了本基金运作的各个环节。

二、报告期内，监察稽核过程中未发现本基金运作过程存在重大违反法律法规、内部控制制度的情况，各项相关制度均能有效执行，本基金的运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的利益。

本基金管理人将继续加强旗下基金运作的检查监督，不断完善和优化操作流程，充实和改进内控技术方法与手段，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，防范和控制各种风险，合法合规、诚实信用、勤勉尽责地运作基金财产。

#### 4.7 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。

#### **4.8 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。

#### **4.9 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**

2022年度，基金托管人在天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2022年度，天治基金管理有限公司在天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2022年度，由天治基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### **§6 审计报告**

#### **6.1 审计报告基本信息**



财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第60467615_B06号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）的财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于天治核心成长混合型证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任

	<p>是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰</p>

	<p>当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	石静筠	沈熙苑
会计师事务所的地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼	
审计报告日期	2023-03-21	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			

银行存款	7.4.7.1	18,709,617.04	28,471,002.82
结算备付金		3,316,100.15	4,466,748.89
存出保证金		341,282.63	546,069.04
交易性金融资产	7.4.7.2	294,661,736.38	450,501,988.71
其中：股票投资		294,661,736.38	450,501,988.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		136,663.40	21,020,105.28
应收股利		-	-
应收申购款		2,380.46	11,378.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	8,012.89
资产总计		317,167,780.06	505,025,306.54
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		16,833.12	20,951,550.75
应付赎回款		8,330.02	76,825.75
应付管理人报酬		329,308.51	507,102.36
应付托管费		68,605.93	105,646.32
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	3,165,147.25	4,394,794.48
负债合计		3,588,224.83	26,035,919.66
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	320,911,059.83	321,240,367.77
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-7,331,504.60	157,749,019.11
净资产合计		313,579,555.23	478,989,386.88
负债和净资产总计		317,167,780.06	505,025,306.54

注：（1）报告截止日2022年12月31日，基金份额净值0.5008元，基金份额总额626,191,168.43份。

（2）比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2022年01月01日至2022年12月31日	2021年01月01日至2021年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-159,304,520.97	73,315,285.20
1.利息收入		233,459.94	408,380.16
其中：存款利息收入	7.4.7.9	233,459.94	261,491.54
债券利息收入		-	146,888.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-155,530,888.02	133,858,372.92
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-158,136,722.28	129,386,928.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	491,484.99	727,559.57
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,114,349.27	3,743,885.34
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）	7.4.7.16	-4,022,604.99	-61,049,373.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	15,512.10	97,905.30
<b>减：二、营业总支出</b>		5,661,349.52	26,462,085.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,514,945.18	6,020,763.18

2. 托管费	7.4.10.2.2	940,613.55	1,254,325.69
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	202.11
其中：卖出回购金融资产支出		-	202.11
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		0.79	0.09
8. 其他费用	7.4.7.19	205,790.00	19,186,794.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-164,965,870.49	46,853,199.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-164,965,870.49	46,853,199.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-164,965,870.49	46,853,199.41

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31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）	321,240,367.77	-	157,749,019.11	478,989,386.88

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）	321,240,367.77	-	157,749,019.11	478,989,386.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-329,307.94	-	-165,080,523.71	-165,409,831.65
（一）、综合收益总额	-	-	-164,965,870.49	-164,965,870.49
（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）	-329,307.94	-	-114,653.22	-443,961.16
其中：1.基金申购款	20,399,869.18	-	3,848,277.22	24,248,146.40
2.基金赎回款	-20,729,177.12	-	-3,962,930.44	-24,692,107.56
（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）	320,911,059.83	-	-7,331,504.60	313,579,555.23



值)				
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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）	422,838,709.64	-	157,574,219.21	580,412,928.85
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）	422,838,709.64	-	157,574,219.21	580,412,928.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-101,598,341.87	-	174,799.90	-101,423,541.97
（一）、综合收益总额	-	-	46,853,199.41	46,853,199.41
（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）	-101,598,341.87	-	-46,678,399.51	-148,276,741.38
其中：1.基金申购款	38,179,103.28	-	17,156,659.25	55,335,762.53
2.基金赎回款	-139,777,445.15	-	-63,835,058.76	-203,612,503.91
（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）	321,240,367.77	-	157,749,019.11	478,989,386.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

徐克磊

徐克磊

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

鉴于《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《关于实施<公开募集证券投资基金运作管理办法>有关问题的规定》的相关要求，经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，自2015年8月4日起本基金更名为天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）。

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

府债券等短期金融工具不低于基金净资产的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《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。

#### 7.4.3 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12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 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。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益分配比例按有关规定制定，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的50%；

- (3) 基金投资当期亏损，则不进行收益分配；
- (4) 基金当年收益应先弥补以前年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- (5) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- (6) 基金份额登记在注册登记系统的投资者可以选择现金分红或红利再投资；基金份额登记在证券登记结算系统的投资者只能选择现金分红；本基金分红的默认方式为现金分红；投资者选择红利再投资时，分配的基金收益以权益登记日的基金份额净值为基准自动转换为基金份额进行再投资；
- (7) 基金收益每年最多分配6次，但若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；
- (8) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。此外，本基金亦已执行财政部于2022年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》（财会[2022]14号）。

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。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。



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28,471,002.82元，自应收利息转入的重分类金额为人民币5,757.09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28,476,759.91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4,466,748.89元，自应收利息转入的重分类金额为人民币2,010.10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4,468,758.99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546,069.04元，自应收利息转入的重分类金额为人民币245.70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546,314.74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8,012.89元，转出至银行存款的重分类金额为人民币5,757.09元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币2,010.10元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币245.70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。

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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

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

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

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

#### 7.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 7.4.6.4 企业所得税

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

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

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

#### 7.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	18,709,617.04	28,471,002.82

等于：本金	18,705,868.28	28,471,002.82
加：应计利息	3,748.76	-
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	18,709,617.04	28,471,002.82

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	295,765,872.42	-	294,661,736.38	-1,104,136.04
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	295,765,872.42	-	294,661,736.38	-1,104,136.04
项目	上年度末 2021年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	447,583,519.76	-	450,501,988.71	2,918,468.95
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	447,583,519.76	-	450,501,988.71	2,918,468.95

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	8,012.89
其他应收款	-	-

待摊费用	-	-
合计	-	8,012.89

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	1.99
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,932,730.71	4,157,375.95
其中：交易所市场	2,932,730.71	4,157,375.95
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	45,000.00	50,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
其他	67,416.54	67,416.54
合计	3,165,147.25	4,394,794.48

#### 7.4.7.7 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	626,833,690.80	321,240,367.77
本期申购	39,805,955.12	20,399,869.18
本期赎回（以“-”号填列）	-40,448,477.49	-20,729,177.12
本期末	626,191,168.43	320,911,059.83

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 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	339,612,679.49	-181,863,660.38	157,749,019.11
本期利润	-160,943,265.50	-4,022,604.99	-164,965,870.49
本期基金份额交易产生的变动数	87,835.76	-202,488.98	-114,653.22
其中：基金申购款	16,212,381.57	-12,364,104.35	3,848,277.22
基金赎回款	-16,124,545.81	12,161,615.37	-3,962,930.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	178,757,249.75	-186,088,754.35	-7,331,504.60

#### 7.4.7.9 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	159,467.05	149,913.09
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	66,705.05	105,223.30
其他	7,287.84	6,355.15
合计	233,459.94	261,491.54

#### 7.4.7.10 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	5,200,859,774.11	6,299,782,237.04
减：卖出股票成本总额	5,343,288,693.38	6,170,395,309.03
减：交易费用	15,707,803.01	-
买卖股票差价收入	-158,136,722.28	129,386,928.01

**7.4.7.11 债券投资收益****7.4.7.11.1 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	218.24	-
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	491,266.75	727,559.57
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	491,484.99	727,559.57

**7.4.7.11.2 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12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	2,031,518.90	43,584,868.43
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	1,540,000.00	42,323,130.00
减：应计利息总额	224.88	534,178.86
减：交易费用	27.27	-
买卖债券差价收入	491,266.75	727,559.57

**7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入**

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。



**7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入**

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。

**7.4.7.12 资产支持证券投资收益**

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。

**7.4.7.13 贵金属投资收益****7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

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。

**7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

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。

**7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

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。

**7.4.7.14 衍生工具收益****7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

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。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

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。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,114,349.27	3,743,885.34
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	2,114,349.27	3,743,885.34

#### 7.4.7.16 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12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-4,022,604.99	-61,049,373.18
——股票投资	-4,022,604.99	-60,911,853.18
——债券投资	-	-137,520.00
——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	-4,022,604.99	-61,049,373.18

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	15,512.10	97,905.30
合计	15,512.10	97,905.30

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失（上年度可比期间：不适用）。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	45,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	4,790.00	7,050.45
账户维护费	36,000.00	36,000.00
上市年费	-	60,000.00
交易费用	-	18,913,744.27
合计	205,790.00	19,186,794.72

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天治基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构
吉林省信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国吉林森林工业集团有限责任公司	基金管理人的股东
天治北部资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

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。

#### 7.4.10 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。

**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

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股票交易。

**7.4.10.1.2 权证交易**

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权证交易。

**7.4.10.1.3 债券交易**

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债券交易。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

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债券回购交易。

**7.4.10.1.5 基金交易**

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基金交易。

**7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

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。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,514,945.18	6,020,763.18
其中：支付销售机构的客户维护费	881,369.73	1,152,056.14

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	940,613.55	1,254,325.69

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

**7.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

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。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

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。

**7.4.10.4.2 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**

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。

**7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2022年01月01日至2022年12月31日		2021年01月01日至2021年12月31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	18,709,617.04	159,467.05	28,471,002.82	149,913.09
------------	---------------	------------	---------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。另外，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2022年12月31日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2021年12月31日：同）。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301115	建科股份	2022-08-23	6个月	新股限售	42.05	24.04	460	19,343.00	11,058.40	-
301121	紫建电子	2022-08-01	6个月	新股限售	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301132	满坤科技	2022-08-03	6个月	新股限售	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301152	天力锂能	2022-08-19	6个月	新股限售	57.00	46.64	294	16,758.00	13,712.16	-
301165	锐捷网络	2022-11-14	6个月	新股限售	32.38	31.61	466	15,089.08	14,730.26	-

301171	易点天下	2022-08-10	6个月	新股限售	18.18	17.72	663	12,053.34	11,748.36	-
301195	北路智控	2022-07-25	6个月	新股限售	71.17	73.04	265	18,860.05	19,355.60	-
301223	中荣股份	2022-10-13	6个月	新股限售	26.28	18.13	596	15,662.88	10,805.48	-
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6个月	新股限售	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301231	荣信文化	2022-08-31	6个月	新股限售	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月	新股限售	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6个月	新股限售	33.65	69.68	479	16,118.35	33,376.72	-
301267	华夏眼科	2022-10-26	6个月	新股限售	50.88	66.20	296	15,060.48	19,595.20	-
301269	华大九天	2022-07-21	6个月	新股限售	32.69	87.94	422	13,795.18	37,110.68	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6个月	新股限售	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301280	珠城科技	2022-12-19	6个月	新股限售	67.40	44.80	251	16,917.40	11,244.80	-
301282	金禄电子	2022-08-18	6个月	新股限售	30.38	25.25	407	12,364.66	10,276.75	-
301296	新巨丰	2022-08-26	6个月	新股限售	18.19	14.90	959	17,444.21	14,289.10	-
301297	富乐德	2022-12-23	6个月	新股限售	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301300	远翔新材	2022-08-09	6个月	新股限售	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301306	西测测试	2022-07-19	6个月	新股限售	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
3013	江波	2022-	6个	新股	55.67	56.72	397	22,10	22,51	-

08	龙	07-27	月	限售				0.99	7.84	
301309	万得凯	2022-09-08	6个月	新股限售	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6个月	新股限售	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6个月	新股限售	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301318	维海德	2022-08-03	6个月	新股限售	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301327	华宝新能	2022-09-08	6个月	新股限售	237.50	176.97	158	37,525.00	27,961.26	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6个月	新股限售	78.80	76.96	167	13,159.60	12,852.32	-
301330	熵基科技	2022-08-10	6个月	新股限售	43.32	31.31	530	22,959.60	16,594.30	-
301335	天元宠物	2022-11-11	6个月	新股限售	49.98	33.82	375	18,742.50	12,682.50	-
301349	信德新材	2022-08-30	6个月	新股限售	138.88	103.52	89	12,360.32	9,213.28	-
301356	天振股份	2022-11-03	6个月	新股限售	63.00	43.33	264	16,632.00	11,439.12	-
301361	众智科技	2022-11-08	6个月	新股限售	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301363	美好医疗	2022-09-28	6个月	新股限售	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301365	矩阵股份	2022-11-14	6个月	新股限售	34.72	23.87	511	17,741.92	12,197.57	-
301366	一博科技	2022-09-19	6个月	新股限售	65.35	45.09	228	14,899.80	10,280.52	-
301367	怡和嘉业	2022-10-21	6个月	新股限售	119.88	175.78	110	13,186.80	19,335.80	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6个月	新股限售	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-



301388	欣灵电气	2022-10-26	6个月	新股限售	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
688351	微电生理	2022-08-23	6个月	新股限售	16.51	24.76	9,440	155,854.40	233,734.40	-
688420	美腾科技	2022-12-01	6个月	新股限售	48.96	39.04	2,339	114,517.44	91,314.56	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注7.4.12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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量

在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	18,709,617.04	-	-	-	-	-	18,709,617.04
结算备付金	3,316,100.15	-	-	-	-	-	3,316,100.15
存出保证金	341,282.63	-	-	-	-	-	341,282.63
交易性金融资产	-	-	-	-	-	294,661,736.38	294,661,736.38
应收清算款	-	-	-	-	-	136,663.40	136,663.40
应收申购款	-	-	-	-	-	2,380.46	2,380.46
资产总计	22,366,999.82	-	-	-	-	294,800,780.24	317,167,780.06
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	16,833.12	16,833.12
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,330.02	8,330.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	329,308.51	329,308.51
应付托管费	-	-	-	-	-	68,605.93	68,605.93
其他负债	-	-	-	-	-	3,165,147.25	3,165,147.25
负债总计	-	-	-	-	-	3,588,224.83	3,588,224.83
利率敏感度缺口	22,366,999.82	-	-	-	-	291,212,555.41	313,579,555.23
上年度末 2021 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	28,471,002.82	-	-	-	-	-	28,471,002.82

结算备付金	4,466,748.89	-	-	-	-	-	4,466,748.89
存出保证金	546,069.04	-	-	-	-	-	546,069.04
交易性金融资产	-	-	-	-	-	450,501,988.71	450,501,988.71
应收证券清算款	-	-	-	-	-	21,020,105.28	21,020,105.28
应收申购款	-	-	-	-	-	11,378.91	11,378.91
其他资产	-	-	-	-	-	8,012.89	8,012.89
资产总计	33,483,820.75	-	-	-	-	471,541,485.79	505,025,306.54
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	20,951,550.75	20,951,550.75
应付赎回款	-	-	-	-	-	76,825.75	76,825.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	507,102.36	507,102.36
应付托管费	-	-	-	-	-	105,646.32	105,646.32
其他负债	-	-	-	-	-	4,394,794.48	4,394,794.48
负债总计	-	-	-	-	-	26,035,919.66	26,035,919.66
利率敏感度缺口	33,483,820.75	-	-	-	-	445,505,566.13	478,989,386.88

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末和上年度末均未持有债券投资，故无利率风险。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	294,661,736.38	93.97	450,501,988.71	94.05
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	294,661,736.38	93.97	450,501,988.71	94.05

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2021年12月31日

	业绩比较基准变动+5%	18,772,617.02	41,507,270.92
	业绩比较基准变动-5%	-18,772,617.02	-41,507,270.92

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	293,826,155.04	447,167,304.57
第二层次	-	615,688.35
第三层次	835,581.34	2,718,995.79
合计	294,661,736.38	450,501,988.71

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日

	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,718,995.79	2,718,995.79
当期购买	-	810,060.49	810,060.49
当期出售/结算	-	977,896.05	977,896.05
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,241,832.08	1,241,832.08
当期利得或损失总额	-	-473,746.81	-473,746.81
其中：计入损益的利得或损失	-	-473,746.81	-473,746.81
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	835,581.34	835,581.34
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	25,520.85	25,520.85
项目	上年度可比同期		
	2021年01月01日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
债券投资	股票投资		
期初余额	-	29,692,342.38	29,692,342.38
当期购买	-	1,500,339.20	1,500,339.20
当期出售/结算	-	1,530,906.13	1,530,906.13
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	27,909,937.62	27,909,937.62
当期利得或损失总额	-	967,157.96	967,157.96
其中：计入损益的利得或损失	-	967,157.96	967,157.96
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	2,718,995.79	2,718,995.79
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,218,656.59	1,218,656.59

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	835,581.34	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2063-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	2,718,995.79	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.3022-2.7417	负相关

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 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。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准



本财务报表已于2023年03月21日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	294,661,736.38	92.90
	其中：股票	294,661,736.38	92.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,025,717.19	6.94
8	其他各项资产	480,326.49	0.15
9	合计	317,167,780.06	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	10,729,161.00	3.42
B	采矿业	-	-
C	制造业	121,988,826.37	38.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	5,451,642.00	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	20,247,412.00	6.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,724,297.10	19.36
J	金融业	47,630,324.00	15.19
K	房地产业	9,584,120.00	3.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	47,224.77	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,210,427.92	5.81
R	文化、体育和娱乐业	48,301.22	0.02
S	综合	-	-
	合计	294,661,736.38	93.97

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	601318	中国平安	286,600	13,470,200.00	4.30
2	603477	巨星农牧	439,900	10,729,161.00	3.42
3	600009	上海机场	176,600	10,191,586.00	3.25
4	300059	东方财富	506,600	9,828,040.00	3.13
5	002371	北方华创	43,600	9,823,080.00	3.13
6	601601	中国太保	396,600	9,724,632.00	3.10
7	600536	中国软件	166,560	9,715,444.80	3.10
8	000002	万科A	526,600	9,584,120.00	3.06

9	002049	紫光国微	72,600	9,570,132.00	3.05
10	300687	赛意信息	316,600	9,339,700.00	2.98
11	003029	吉大正元	258,600	9,118,236.00	2.91
12	002271	东方雨虹	266,600	8,949,762.00	2.85
13	600845	宝信软件	196,600	8,807,680.00	2.81
14	688031	星环科技	96,600	8,790,600.00	2.80
15	300496	中科创达	86,600	8,685,980.00	2.77
16	600763	通策医疗	50,600	7,741,294.00	2.47
17	300015	爱尔眼科	236,600	7,351,162.00	2.34
18	600600	青岛啤酒	66,600	7,159,500.00	2.28
19	600809	山西汾酒	23,600	6,725,764.00	2.14
20	688271	联影医疗	36,609	6,479,060.82	2.07
21	600132	重庆啤酒	50,600	6,445,428.00	2.06
22	000858	五粮液	35,600	6,432,564.00	2.05
23	300122	智飞生物	72,600	6,376,458.00	2.03
24	600029	南方航空	796,600	6,054,160.00	1.93
25	300226	上海钢联	216,600	6,001,986.00	1.91
26	000568	泸州老窖	26,600	5,965,848.00	1.90
27	300999	金龙鱼	136,600	5,950,296.00	1.90
28	600276	恒瑞医药	153,600	5,918,208.00	1.89
29	002304	洋河股份	35,000	5,617,500.00	1.79
30	300755	华致酒行	176,600	5,451,642.00	1.74
31	600887	伊利股份	166,600	5,164,600.00	1.65
32	000651	格力电器	136,600	4,414,912.00	1.41
33	002142	宁波银行	129,600	4,205,520.00	1.34
34	600004	白云机场	266,600	4,001,666.00	1.28
35	300390	天华超净	66,600	3,721,608.00	1.19
36	600036	招商银行	99,600	3,711,096.00	1.18
37	603801	志邦家居	126,600	3,403,008.00	1.09
38	300896	爱美客	6,000	3,398,100.00	1.08
39	000001	平安银行	256,600	3,376,856.00	1.08

40	601838	成都银行	216,600	3,313,980.00	1.06
41	002044	美年健康	500,000	3,065,000.00	0.98
42	002508	老板电器	106,600	2,959,216.00	0.94
43	600690	海尔智家	116,600	2,852,036.00	0.91
44	603833	欧派家居	16,600	2,017,398.00	0.64
45	000333	美的集团	36,600	1,895,880.00	0.60
46	688351	微电生理	9,440	233,734.40	0.07
47	301195	北路智控	2,650	197,515.10	0.06
48	688420	美腾科技	2,339	91,314.56	0.03
49	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.02
50	001330	博纳影业	3,564	42,696.72	0.01
51	301269	华大九天	422	37,110.68	0.01
52	301239	普瑞眼科	479	33,376.72	0.01
53	301327	华宝新能	158	27,961.26	0.01
54	301238	瑞泰新材	1,036	23,299.64	0.01
55	301308	江波龙	397	22,517.84	0.01
56	301267	华夏眼科	296	19,595.20	0.01
57	301367	怡和嘉业	110	19,335.80	0.01
58	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.01
59	301330	熵基科技	530	16,594.30	0.01
60	301165	锐捷网络	466	14,730.26	0.00
61	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
62	301296	新巨丰	959	14,289.10	0.00
63	301152	天力锂能	294	13,712.16	0.00
64	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
65	603130	云中马	480	13,176.00	0.00
66	301328	维峰电子	167	12,852.32	0.00
67	301335	天元宠物	375	12,682.50	0.00
68	301365	矩阵股份	511	12,197.57	0.00
69	301171	易点天下	663	11,748.36	0.00
70	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00

71	301356	天振股份	264	11,439.12	0.00
72	301280	珠城科技	251	11,244.80	0.00
73	301115	建科股份	460	11,058.40	0.00
74	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
75	301223	中荣股份	596	10,805.48	0.00
76	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
77	301366	一博科技	228	10,280.52	0.00
78	301282	金禄电子	407	10,276.75	0.00
79	301349	信德新材	89	9,213.28	0.00
80	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
81	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
82	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
83	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
84	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
85	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
86	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
87	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
88	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
89	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
90	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	300498	温氏股份	107,973,342.81	22.54
2	002714	牧原股份	97,929,342.61	20.44
3	603363	傲农生物	86,209,588.95	18.00
4	300750	宁德时代	81,138,792.21	16.94
5	600547	山东黄金	75,941,504.00	15.85

6	000630	铜陵有色	73,363,383.64	15.32
7	601600	中国铝业	71,041,938.67	14.83
8	603993	洛阳钼业	70,860,077.14	14.79
9	002460	赣锋锂业	70,352,008.00	14.69
10	300122	智飞生物	69,015,530.24	14.41
11	002466	天齐锂业	68,895,717.34	14.38
12	600111	北方稀土	66,840,919.06	13.95
13	002100	天康生物	64,078,370.31	13.38
14	601899	紫金矿业	62,341,051.79	13.02
15	600438	通威股份	58,505,969.17	12.21
16	603799	华友钴业	57,859,932.70	12.08
17	600690	海尔智家	56,681,351.58	11.83
18	601888	中国中免	55,811,057.48	11.65
19	688111	金山办公	52,751,123.78	11.01
20	000876	新希望	51,085,007.18	10.67
21	002271	东方雨虹	50,816,851.87	10.61
22	000625	长安汽车	48,182,894.63	10.06
23	600497	驰宏锌锗	47,086,151.62	9.83
24	603833	欧派家居	45,704,651.40	9.54
25	002567	唐人神	45,319,246.64	9.46
26	600276	恒瑞医药	45,011,423.41	9.40
27	600570	恒生电子	44,966,250.68	9.39
28	601238	广汽集团	43,220,446.93	9.02
29	688005	容百科技	42,915,945.89	8.96
30	002371	北方华创	42,531,847.34	8.88
31	002049	紫光国微	42,413,393.60	8.85
32	601012	隆基绿能	42,115,783.68	8.79
33	600845	宝信软件	40,869,756.96	8.53
34	300015	爱尔眼科	39,993,774.05	8.35
35	002709	天赐材料	39,680,638.83	8.28
36	603477	巨星农牧	39,573,897.00	8.26

37	300274	阳光电源	39,394,958.06	8.22
38	601111	中国国航	39,321,227.80	8.21
39	002241	歌尔股份	38,436,379.96	8.02
40	600536	中国软件	36,565,524.23	7.63
41	002475	立讯精密	36,247,935.71	7.57
42	002268	卫士通	35,533,681.48	7.42
43	300496	中科创达	34,960,900.34	7.30
44	603501	韦尔股份	31,520,628.19	6.58
45	000933	神火股份	29,347,244.28	6.13
46	002240	盛新锂能	28,507,239.00	5.95
47	300035	中科电气	28,442,926.24	5.94
48	300390	天华超净	28,113,523.00	5.87
49	601601	中国太保	28,067,186.00	5.86
50	002812	恩捷股份	27,791,423.32	5.80
51	002311	海大集团	27,419,960.99	5.72
52	601318	中国平安	27,016,230.00	5.64
53	600588	用友网络	27,013,064.20	5.64
54	300760	迈瑞医疗	26,817,072.00	5.60
55	000661	长春高新	25,920,065.00	5.41
56	601658	邮储银行	24,693,261.11	5.16
57	688677	海泰新光	24,629,719.06	5.14
58	601166	兴业银行	24,513,803.00	5.12
59	000887	中鼎股份	24,512,475.28	5.12
60	600660	福耀玻璃	24,361,332.00	5.09
61	002050	三花智控	24,361,257.80	5.09
62	000975	银泰黄金	24,067,462.96	5.02
63	000807	云铝股份	23,626,122.00	4.93
64	002142	宁波银行	23,283,680.34	4.86
65	300896	爱美客	23,145,934.52	4.83
66	300687	赛意信息	23,133,562.00	4.83
67	688008	澜起科技	23,100,101.88	4.82

68	600975	新五丰	22,751,211.00	4.75
69	601009	南京银行	22,416,724.09	4.68
70	600499	科达制造	21,597,109.00	4.51
71	600745	闻泰科技	21,594,320.80	4.51
72	002036	联创电子	21,306,589.92	4.45
73	600418	江淮汽车	21,194,397.00	4.42
74	300737	科顺股份	20,826,496.88	4.35
75	600988	赤峰黄金	20,452,358.00	4.27
76	002043	兔宝宝	20,122,059.96	4.20
77	600703	三安光电	20,032,139.04	4.18
78	002041	登海种业	19,834,633.42	4.14
79	300450	先导智能	19,817,088.78	4.14
80	603806	福斯特	19,403,913.40	4.05
81	601838	成都银行	19,351,905.85	4.04
82	600309	万华化学	19,026,565.00	3.97
83	002385	大北农	18,947,051.31	3.96
84	002352	顺丰控股	18,855,372.00	3.94
85	601952	苏垦农发	18,721,684.92	3.91
86	600809	山西汾酒	18,655,330.37	3.89
87	000960	锡业股份	18,156,987.67	3.79
88	000568	泸州老窖	17,805,614.02	3.72
89	300014	亿纬锂能	17,619,481.00	3.68
90	000762	西藏矿业	17,615,712.00	3.68
91	600926	杭州银行	17,231,176.17	3.60
92	000998	隆平高科	17,229,385.38	3.60
93	600050	中国联通	17,143,875.00	3.58
94	601689	拓普集团	16,637,844.00	3.47
95	600328	中盐化工	16,410,266.00	3.43
96	002304	洋河股份	16,355,553.00	3.41
97	600741	华域汽车	16,190,985.00	3.38
98	688518	联赢激光	16,118,739.62	3.37



99	688599	天合光能	16,025,062.25	3.35
100	688363	华熙生物	15,954,368.44	3.33
101	600406	国电南瑞	15,740,042.62	3.29
102	600519	贵州茅台	15,689,036.00	3.28
103	603737	三棵树	15,415,593.98	3.22
104	300358	楚天科技	14,967,169.00	3.12
105	002368	太极股份	14,232,870.00	2.97
106	300497	富祥药业	14,213,730.28	2.97
107	600011	华能国际	14,128,178.00	2.95
108	000656	金科股份	14,027,307.00	2.93
109	000976	华铁股份	13,990,013.00	2.92
110	300627	华测导航	13,879,043.60	2.90
111	002126	银轮股份	13,646,636.00	2.85
112	600919	江苏银行	13,558,910.80	2.83
113	002791	坚朗五金	13,480,219.10	2.81
114	000707	双环科技	13,161,253.74	2.75
115	000333	美的集团	13,076,460.89	2.73
116	601677	明泰铝业	13,005,077.00	2.72
117	000001	平安银行	12,995,220.72	2.71
118	000301	东方盛虹	12,958,531.99	2.71
119	600036	招商银行	12,871,379.00	2.69
120	603801	志邦家居	12,793,815.00	2.67
121	603259	药明康德	12,661,945.64	2.64
122	603986	兆易创新	12,654,590.32	2.64
123	300366	创意信息	12,424,020.40	2.59
124	600048	保利发展	12,406,101.51	2.59
125	601919	中远海控	12,389,965.60	2.59
126	300316	晶盛机电	12,367,729.00	2.58
127	300059	东方财富	12,358,718.02	2.58
128	603098	森特股份	12,346,076.00	2.58
129	300347	泰格医药	12,340,262.00	2.58

130	000963	华东医药	12,289,638.00	2.57
131	300996	普联软件	12,125,933.82	2.53
132	002459	晶澳科技	12,114,932.00	2.53
133	001979	招商蛇口	12,109,841.00	2.53
134	600720	祁连山	11,936,203.00	2.49
135	688388	嘉元科技	11,925,345.75	2.49
136	002101	广东鸿图	11,839,598.08	2.47
137	688499	利元亨	11,831,527.19	2.47
138	601225	陕西煤业	11,692,736.96	2.44
139	002192	融捷股份	11,684,447.00	2.44
140	300124	汇川技术	11,660,150.50	2.43
141	002508	老板电器	11,650,806.25	2.43
142	600085	同仁堂	11,548,494.26	2.41
143	002129	TCL中环	11,370,137.00	2.37
144	301080	百普赛斯	11,224,216.22	2.34
145	603369	今世缘	11,178,607.00	2.33
146	603520	司太立	11,111,945.04	2.32
147	300661	圣邦股份	10,974,860.25	2.29
148	000538	云南白药	10,834,645.60	2.26
149	002821	凯莱英	10,781,905.00	2.25
150	002906	华阳集团	10,606,890.00	2.21
151	603301	振德医疗	10,602,610.00	2.21
152	000999	华润三九	10,564,398.00	2.21
153	688131	皓元医药	10,528,996.87	2.20
154	300629	新劲刚	10,440,974.40	2.18
155	600009	上海机场	10,410,961.72	2.17
156	603538	美诺华	10,383,334.28	2.17
157	003029	吉大正元	10,352,168.49	2.16
158	600566	济川药业	10,329,123.44	2.16
159	688126	沪硅产业	10,236,594.87	2.14
160	000739	普洛药业	10,185,414.40	2.13

161	002840	华统股份	10,127,972.00	2.11
162	688031	星环科技	10,061,069.55	2.10
163	600893	航发动力	10,020,880.00	2.09
164	300525	博思软件	9,923,491.97	2.07
165	002507	涪陵榨菜	9,913,503.00	2.07
166	000002	万科A	9,727,606.00	2.03
167	688187	时代电气	9,701,306.29	2.03
168	002063	远光软件	9,682,877.34	2.02
169	300223	北京君正	9,636,068.00	2.01
170	603707	健友股份	9,581,817.20	2.00

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。

#### 8.4.2 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	002460	赣锋锂业	102,100,891.22	21.32
2	002466	天齐锂业	100,020,145.71	20.88
3	300498	温氏股份	97,062,918.88	20.26
4	002714	牧原股份	92,995,662.66	19.41
5	300750	宁德时代	86,071,946.73	17.97
6	601899	紫金矿业	80,033,765.68	16.71
7	000630	铜陵有色	77,626,025.23	16.21
8	603363	傲农生物	77,057,285.16	16.09
9	600547	山东黄金	73,079,007.37	15.26
10	603799	华友钴业	70,022,037.76	14.62
11	603993	洛阳钼业	68,920,146.00	14.39
12	601600	中国铝业	68,223,072.00	14.24
13	600111	北方稀土	67,413,285.42	14.07
14	601012	隆基绿能	63,909,483.46	13.34
15	002100	天康生物	62,388,198.65	13.02

16	300390	天华超净	62,246,556.60	13.00
17	000625	长安汽车	57,467,520.85	12.00
18	300122	智飞生物	56,671,574.64	11.83
19	600438	通威股份	54,262,022.86	11.33
20	002241	歌尔股份	53,719,103.32	11.22
21	601888	中国中免	53,543,025.40	11.18
22	600690	海尔智家	53,389,202.24	11.15
23	002268	电科网安	50,765,436.19	10.60
24	688111	金山办公	50,640,252.12	10.57
25	000876	新希望	49,577,058.71	10.35
26	300274	阳光电源	47,192,989.96	9.85
27	600497	驰宏锌锗	46,708,562.79	9.75
28	600570	恒生电子	44,191,248.83	9.23
29	688005	容百科技	43,464,820.85	9.07
30	603833	欧派家居	41,684,556.32	8.70
31	601238	广汽集团	41,489,076.00	8.66
32	600418	江淮汽车	41,384,016.24	8.64
33	002567	唐人神	41,222,973.23	8.61
34	600276	恒瑞医药	40,522,511.82	8.46
35	002271	东方雨虹	39,803,804.29	8.31
36	002709	天赐材料	39,163,568.11	8.18
37	000887	中鼎股份	38,642,794.50	8.07
38	601111	中国国航	37,041,171.27	7.73
39	002475	立讯精密	35,325,042.92	7.37
40	002371	北方华创	32,440,010.75	6.77
41	600845	宝信软件	31,908,236.42	6.66
42	603501	韦尔股份	31,269,822.00	6.53
43	600499	科达制造	30,699,824.00	6.41
44	000933	神火股份	30,335,969.20	6.33
45	002049	紫光国微	30,188,336.75	6.30
46	300015	爱尔眼科	29,855,226.97	6.23

47	603477	巨星农牧	28,596,092.00	5.97
48	002240	盛新锂能	27,996,440.37	5.84
49	002812	恩捷股份	27,401,714.01	5.72
50	300035	中科电气	27,064,029.91	5.65
51	688008	澜起科技	26,348,070.43	5.50
52	002311	海大集团	26,150,444.97	5.46
53	600588	用友网络	25,393,631.43	5.30
54	300760	迈瑞医疗	25,206,542.00	5.26
55	002050	三花智控	25,119,040.00	5.24
56	688677	海泰新光	24,189,191.83	5.05
57	002036	联创电子	23,888,930.17	4.99
58	600660	福耀玻璃	23,655,027.32	4.94
59	600536	中国软件	23,601,486.28	4.93
60	300496	中科创达	23,087,404.00	4.82
61	600406	国电南瑞	22,945,752.49	4.79
62	601658	邮储银行	22,869,007.00	4.77
63	300450	先导智能	22,648,617.00	4.73
64	000807	云铝股份	22,563,132.39	4.71
65	000661	长春高新	22,044,645.20	4.60
66	601166	兴业银行	21,808,229.00	4.55
67	000975	银泰黄金	21,785,797.00	4.55
68	000762	西藏矿业	21,677,180.00	4.53
69	688599	天合光能	21,366,564.34	4.46
70	002041	登海种业	21,151,728.00	4.42
71	601009	南京银行	21,135,806.45	4.41
72	601689	拓普集团	21,129,257.00	4.41
73	002385	大北农	21,079,795.00	4.40
74	300737	科顺股份	20,872,289.82	4.36
75	600988	赤峰黄金	20,592,942.91	4.30
76	600745	闻泰科技	20,268,499.00	4.23
77	601952	苏垦农发	20,258,967.17	4.23

78	002043	兔宝宝	20,143,266.00	4.21
79	002459	晶澳科技	20,087,923.76	4.19
80	601601	中国太保	19,818,487.00	4.14
81	002236	大华股份	19,818,120.00	4.14
82	600703	三安光电	19,591,729.04	4.09
83	600975	新五丰	19,541,373.60	4.08
84	300059	东方财富	19,471,542.40	4.07
85	600011	华能国际	19,170,397.00	4.00
86	300316	晶盛机电	19,091,466.50	3.99
87	600309	万华化学	19,018,060.00	3.97
88	000739	普洛药业	18,737,675.00	3.91
89	000998	隆平高科	18,557,648.06	3.87
90	002352	顺丰控股	18,444,204.00	3.85
91	300896	爱美客	18,147,852.00	3.79
92	603806	福斯特	17,654,929.40	3.69
93	002142	宁波银行	17,530,340.70	3.66
94	600050	中国联通	17,363,315.99	3.62
95	000960	锡业股份	17,273,300.70	3.61
96	300014	亿纬锂能	16,828,316.00	3.51
97	600926	杭州银行	16,813,307.49	3.51
98	600328	中盐化工	16,577,048.00	3.46
99	688518	联赢激光	16,207,372.93	3.38
100	600522	中天科技	16,115,752.00	3.36
101	002101	广东鸿图	16,001,666.60	3.34
102	603737	三棵树	15,833,241.00	3.31
103	600741	华域汽车	15,718,995.30	3.28
104	000707	双环科技	15,660,409.00	3.27
105	600519	贵州茅台	15,417,986.00	3.22
106	000999	华润三九	15,234,856.90	3.18
107	002126	银轮股份	14,996,824.00	3.13
108	601318	中国平安	14,959,279.15	3.12

109	002368	太极股份	14,841,415.40	3.10
110	601838	成都银行	14,522,585.00	3.03
111	000976	华铁股份	14,356,892.00	3.00
112	300627	华测导航	14,154,787.80	2.96
113	600566	济川药业	13,924,230.62	2.91
114	688499	利元亨	13,744,781.95	2.87
115	002791	坚朗五金	13,442,331.00	2.81
116	300687	赛意信息	13,305,053.40	2.78
117	000301	东方盛虹	13,088,439.00	2.73
118	601225	陕西煤业	12,858,267.00	2.68
119	688363	华熙生物	12,726,588.53	2.66
120	603259	药明康德	12,615,690.00	2.63
121	300358	楚天科技	12,523,993.92	2.61
122	300497	富祥药业	12,455,374.40	2.60
123	600085	同仁堂	12,444,893.68	2.60
124	002192	融捷股份	12,304,930.00	2.57
125	600919	江苏银行	12,227,039.10	2.55
126	603986	兆易创新	12,174,454.46	2.54
127	601677	明泰铝业	11,945,027.00	2.49
128	000656	金科股份	11,814,566.00	2.47
129	600720	祁连山	11,653,148.80	2.43
130	002906	华阳集团	11,606,326.63	2.42
131	002756	永兴材料	11,602,621.00	2.42
132	688388	嘉元科技	11,595,958.07	2.42
133	300661	圣邦股份	11,590,798.82	2.42
134	603098	森特股份	11,312,274.60	2.36
135	601919	中远海控	11,228,626.50	2.34
136	000568	泸州老窖	11,165,787.00	2.33
137	600809	山西汾酒	10,937,539.00	2.28
138	002840	华统股份	10,865,766.00	2.27
139	300124	汇川技术	10,847,688.53	2.26

140	002129	TCL中环	10,834,051.00	2.26
141	000963	华东医药	10,806,117.00	2.26
142	000538	云南白药	10,749,059.60	2.24
143	000002	万科A	10,747,968.00	2.24
144	603301	振德医疗	10,728,994.00	2.24
145	603568	伟明环保	10,720,559.60	2.24
146	000333	美的集团	10,690,803.00	2.23
147	300996	普联软件	10,651,517.00	2.22
148	000858	五粮液	10,646,565.98	2.22
149	600048	保利发展	10,624,024.00	2.22
150	300366	创意信息	10,530,635.00	2.20
151	603369	今世缘	10,511,664.00	2.19
152	603520	司太立	10,411,391.00	2.17
153	001979	招商蛇口	10,406,194.00	2.17
154	002304	洋河股份	10,378,953.96	2.17
155	601868	中国能建	10,330,361.00	2.16
156	002507	涪陵榨菜	10,183,527.43	2.13
157	300629	新劲刚	10,164,925.10	2.12
158	300223	北京君正	10,096,227.00	2.11
159	688126	沪硅产业	9,920,537.10	2.07
160	002821	凯莱英	9,761,107.00	2.04
161	600893	航发动力	9,737,364.00	2.03
162	601669	中国电建	9,592,151.00	2.00

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。

#### 8.4.3 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	5,191,471,046.04
卖出股票收入（成交）总额	5,200,859,774.11

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。



## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国平安的发行主体在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 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	341,282.63
2	应收清算款	136,663.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,380.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	480,326.49

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**8.12.6 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。

**§9 基金份额持有人信息****9.1 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
35,666	17,557.09	1,212,230.96	0.19%	624,978,937.47	99.81%

**9.2 期末上市基金前十名持有人**

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
----	-------	---------	----------

1	陈明杰	2,442,839.00	0.39%
2	陈瑞荣	2,150,389.00	0.34%
3	顾伟	606,100.00	0.10%
4	陈红梅	519,879.00	0.08%
5	曹建敏	519,401.00	0.08%
6	杨胜利	480,000.00	0.08%
7	罗雪娟	412,900.00	0.07%
8	聂玉洁	405,000.00	0.06%
9	黄国建	369,915.00	0.06%
10	马文杰	360,000.00	0.06%

本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研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	0~10

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年01月20日)基金份额总额	313,493,538.86
本报告期期初基金份额总额	626,833,690.80
本报告期基金总申购份额	39,805,955.12
减：本报告期基金总赎回份额	40,448,477.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	626,191,168.43

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

本基金管理人于2022年9月17日发布公告，自2022年9月17日起聘任马铁刚先生担任董事长，单宇先生不再担任董事长；本基金管理人于2022年12月24日发布公告，自2022年12月24日起聘任总经理徐克磊先生兼任财务负责人、首席信息官，副总经理闫译文女士自2022年12月24日起不再兼任首席信息官。

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来，未变更过会计师事务所。

本报告年度聘任会计师事务所的报酬为4.5万元整。目前的审计机构-安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已提供审计服务的连续年限为自2006年1月20日至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	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	佣金	占当期佣金总量的	

	元数量		额的比例		比例	
德邦证券	1	483,277,905.03	4.66%	450,076.73	4.70%	-
东北证券	1	892,622,765.37	8.61%	817,205.79	8.53%	-
东方证券	1	340,677,642.17	3.29%	313,867.43	3.28%	-
东吴证券	1	504,104,684.51	4.86%	469,469.92	4.90%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	16,818,572.47	0.16%	15,663.32	0.16%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	305,952,870.68	2.95%	284,934.07	2.97%	-
国联证券	1	275,763,446.36	2.66%	256,817.79	2.68%	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	206,188,571.24	1.99%	189,557.38	1.98%	-
国泰君安	1	429,468,132.60	4.14%	399,965.22	4.17%	-
国信证券	1	194,869,507.52	1.88%	179,534.74	1.87%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	189,767,167.66	1.83%	176,729.61	1.84%	-
开源证券	1	532,482,676.99	5.14%	490,574.89	5.12%	-
民生证券	1	463,177,849.11	4.47%	431,357.27	4.50%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

首创证券	1	251,595,452.63	2.43%	231,795.53	2.42%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	364,788,221.43	3.52%	339,728.94	3.54%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	869,520,535.90	8.39%	809,795.00	8.45%	-
长江证券	2	671,894,194.78	6.48%	614,963.76	6.42%	-
川财证券	2	249,285,971.91	2.40%	228,807.70	2.39%	-
方正证券	2	404,203,919.40	3.90%	370,580.22	3.87%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	315,077,079.79	3.04%	291,612.02	3.04%	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	837,539,963.40	8.08%	765,579.57	7.99%	-
粤开	1	797,906,783.58	7.70%	743,087.20	7.75%	-

证券						
中信建投	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	769,645,013.73	7.42%	711,954.07	7.43%	-

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：新增爱建证券1个交易单元、方正证券1个交易单元、开源证券1个交易单元、首创证券1个交易单元、山西证券2个交易单元，新增广发1个交易单元，退租安信证券1个交易单元、中泰证券1个交易单元。

### 11.7.2 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
德邦证券	468,872.00	23.08%	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-

开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
爱建证券	646,610.10	31.83%	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	916,036.80	45.09%	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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
3	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)2021年第4度报告	中国证监会指定媒介	2022-01-21
4	天治基金管理有限公司旗下基金2021年年度报告提示性	中国证监会指定媒介	2022-03-25



	公告		
5	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)2021年年度报告	中国证监会指定媒介	2022-03-25
6	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
7	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
8	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
9	天治基金管理有限公司旗下基金2022年第1季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-04-21
10	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)2022年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2022-04-21
11	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
12	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
13	天治基金管理有限公司关于天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)变更业绩比较基准并修改基金合同的公告	中国证监会指定媒介	2022-06-17

14	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同	中国证监会指定媒介	2022-06-17
15	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书	中国证监会指定媒介	2022-06-17
16	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2022-06-17
17	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
18	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
19	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加诺亚正行为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2022-06-28
20	天治基金管理有限公司旗下部分基金参加腾安基金费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2022-07-01
21	天治基金管理有限公司旗下基金2022年第2季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-07-20
22	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)2022年第2季度报告	中国证监会指定媒介	2022-07-20
23	天治基金管理有限公司旗下基金增加京东肯特瑞为代销机构、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	2022-08-26
24	天治基金管理有限公司旗下	中国证监会指定媒介	2022-08-30

	基金2022年中期报告提示性公告		
25	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)2022年中期报告	中国证监会指定媒介	2022-08-30
26	天治基金管理有限公司旗下部分基金中期报告更正公告	中国证监会指定媒介	2022-09-06
27	天治基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会指定媒介	2022-09-17
28	天治基金管理有限公司旗下基金2022年第3季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-10-26
29	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)2022年第3季度报告	中国证监会指定媒介	2022-10-26
30	天治基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定媒介	2022-11-19
31	天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书、天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2022-12-09
32	天治基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会指定媒介	2022-12-24
33	天治基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2022-12-24

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

注：本基金本报告期末未存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

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

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

天治基金管理有限公司  
二〇二三年三月二十四日