
天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09月30日

基金管理人:天治基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2024年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本基金2016年4月18日由天治品质优选混合型证券投资基金通过转型变更而来。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 天治低碳经济混合 |
| 基金主代码 | 350002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年04月18日 |
| 报告期末基金份额总额 | 78,481,000.76份 |
| 投资目标 | 在灵活配置股票和债券资产的基础上，精选受益于低碳经济的主题相关企业，追求持续稳健的超额回报。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>资产配置策略方面，本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据宏观经济运行态势、政策变化、市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>本基金实施大类资产配置策略过程中还将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，动态优化投资组合，以规避或控制市场风险，提高基</p> |

| | |
|--------|---|
| | 金收益率。 2、股票投资策略 在全球气候变暖的背景下，以低能耗、低污染为基础的"低碳经济"成为全球热点。低碳经济是一种以低能耗、低污染、低排放为特点的发展模式,是以应对气候变化、保障能源安全、促进经济社会可持续发展有机结合为目的的新规则。本基金将沿着低碳经济的路线，把握其中蕴含的投资机会。 |
| 业绩比较基准 | 中证内地低碳经济主题指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 天治基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2024年07月01日 - 2024年09月30日） |
|----------------|--------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | -1,411,497.60 |
| 2.本期利润 | 9,719,887.24 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1234 |
| 4.期末基金资产净值 | 81,091,906.38 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0333 |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 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 | 净值增长 | 净值增长 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

| | 率① | 率标准差② | 基准收益率③ | 基准收益率标准差④ | | |
|------------|--------|-------|---------|-----------|---------|-------|
| 过去三个月 | 13.61% | 2.41% | 9.93% | 0.86% | 3.68% | 1.55% |
| 过去六个月 | 6.41% | 2.06% | 7.09% | 0.74% | -0.68% | 1.32% |
| 过去一年 | -5.82% | 1.84% | 4.07% | 0.73% | -9.89% | 1.11% |
| 过去三年 | -2.84% | 1.65% | -15.78% | 0.81% | 12.94% | 0.84% |
| 过去五年 | 50.06% | 1.51% | 50.63% | 0.89% | -0.57% | 0.62% |
| 自基金合同生效起至今 | 30.19% | 1.36% | 50.86% | 0.78% | -20.67% | 0.58% |

3.2.2 自基金转型以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|------|--------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|--|------------|---|-----|--|
| 许家涵 | 公司总经理、财务负责人兼投资总监、本基金基金经理、天治稳健双盈债券型证券投资基金基金经理、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天治量化核心精选混合型证券投资基金基金经理 | 2019-02-28 | - | 19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、权益投资部总监 |
|-----|--|------------|---|-----|--|

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度末，国内超预期政策扭转了市场对经济的悲观预期，权益市场否极泰来，海外美联储进入降息周期，美元指数下行，人民币升值。当前国内政策面，货币和财政政策发力稳经济，海外美联储处于降息周期，从投资时钟角度，现在已是投资权益市场的最佳时刻。三季度海外权益市场在美联储降息情形下普遍上涨，其中道琼斯工业指数上涨8.21%，国内权益市场季末大幅快速反弹，沪深300上涨16.07%，创业板上涨29.21%。商品市场分化，供给端因素扰动原油大幅下跌，工业金属表现偏弱，降息和地缘政治催化金价大幅上涨。降息周期下，美债利率下行，国内经济预期改善，十年期小幅上行。

三季度国内经济主要特征是内需不足、外需具有一定韧性。经济下行、消费倾向下降以及收入预期不确定情形下，居民消费低迷，房企面临现金流量表和资产负债表冲击，土地出让收入大幅下行冲击地方政府财政收支平衡。在经济偏弱、企业居民信心不足和市场较悲观的时刻，9月24日央行、金融监管总局和证监会释放一揽子宽货币、稳经济和稳市场金融政策，货币政策降准、降息略超市场预期；地产政策方面，调降存量房贷利率将减少居民房贷利率负担，有利于提振居民消费以及缓解银行提前还贷压力。政策对资本市场的呵护超预期，1) 创设货币政策工具支持股票市场稳定发展；2) 创设股票回购增持专项再贷款，利好红利大盘风格；3) 推动中长期资金入市、支持并购重组、市值管理等。9月26日政治局会议强调加大逆周期财政力度、促进房地产市场止跌回稳以及提振资本市场，地产下行压力是导致当前国内经济偏弱的重要因素，地产的企稳将大幅改善市场对国内经济的信心。超预期政策组合拳提振市场信心，扭转市场对国内经济悲观预期，三季度末权益市场大幅反弹。总体来看，宏观政策基调已有本质转变，对后续政策力度和持续性可以保持期待。

海外，美国经济仍维持韧性，就业市场有所降温，服务业是美国新增就业较多的领域。美联储9月18日超预期降息50BP，美国经济当前总体仍然稳健，通胀当前没有显著上行的压力，美联储的政策立场当前有一定调整，更加关注就业。当前，美国制造业PMI偏弱，服务业PMI维持相对景气，本轮周期财政扩张和私人企业部门锁定低贷款利率带来了疫后经济韧性，居民部门杠杆率还维持低位。中期看，受到移民、劳动生产效率提升、科技进步以及产业政策下资本支出回升，美国中性利率水平相对疫情前抬升。当前美国大选前景仍不明朗，关注美国大选对国内经济的影响，预计美联储将继续降息，经济韧性的情形下四季度大幅降息的概率相对较低。全球范围内降息央行的数量逐步增加，金融条件总体趋于宽松，全球制造业短期复苏有一定波折但处于相对底部区域，从中期来看，随着货币环境的进一步改善，全球制造业中期仍维持上行趋势。

基金操作层面，低碳经济基金主要关注符合高质量发展政策导向以及景气度有望持续改善的成长领域投资机会，重点布局消费电子、自动驾驶、人工智能和信创等领域。

我们看好供给格局优化，需求改善空间大，符合新质生产力导向，盈利具有爆发性，具备周期或成长特征的行业和标的。重点看好两条线：1) 布局后续财政发力所带来公司业绩预期改善修复明显的方向，包括信创、数据要素、卫星互联网、半导体国产替代、

华为产业链、传媒场馆建设等，详细逻辑后续展开。2) 布局下半年以及明年业绩较好板块，包括AI终端、AI服务器、国产GPU、智能驾驶以及游戏。

现阶段的信创行业有点像新能源补贴后的爆发初期阶段，看好四季度以及明年信创大行情具备戴维斯双击潜力。7月30日，中共中央政治局召开会议，本次会议再次强调了关键核心技术攻关的重要性，新提了防止“内卷式”恶性竞争，同时要发展瞪羚企业、独角兽企业，充分说明了国家对关键核心技术安全可控的重视。信创发展大势所趋，“大信创”全面铺开下万亿市场机遇广阔。信创是对中国IT系统框架的全面重构，将推动中国底层基础软硬件、中间层再到上层应用软件的全面国产化替换。分环节来看，以CPU、操作系统、数据库、中间件为代表的基础IT软硬件层上，我国IT产业的国产化率仍然较低，多项领域的国产化均不到10%，整体仍有较大的国产化率应用提升空间。在科技自立自强的大战略下，预期党政、行业、央国企信创都有望迎来边际好转。

端侧大模型今年百花齐放，孕育终端新的生态。继5G之后的新一轮换机已至，存量替换需求有望被激活。看好AI引领的新一轮消费电子创新周期，第三方机构预测2024年全球智能手机市场将增长2.8%至12亿部。Canalys预测，2024年底新机中AI手机的占比将达到16%，并在未来数年内呈指数级增长，2028年新机中AI手机的占比预计将达到54%。当前存量智能手机使用时长已接近换机时点，苹果WWDC24发布Apple Intelligence，将生成式AI模型置于iPhone、iPad和Mac等设备，有望推动消费终端新一轮换机需求的释放。从当前智能手机、PC和TWS耳机季度出货同比来看，消费电子需求复苏拐点已到，2024Q4安卓新品也将密集发布，进一步提振消费电子升级需求。AI终端在计算、存储、感知、交互等方面的性能大幅提升，同时配套的电源、散热、元器件、结构等支持也相应增加，软件和硬件创新带来产业链价值重构。

随着高阶自动驾驶功能陆续搭载，消费者自动驾驶认知得到启蒙。自动驾驶功能向着全场景覆盖、全程使用发展，能够简化驾驶操作、缓解驾驶疲劳，同时有望重塑用户驾驶出行习惯，因而具有坚实的需求确定性，并且自动驾驶正逐渐成为影响消费者购车决策的重要参考要素。自动驾驶的快速渗透需要由供给驱动转变为需求驱动，当前高阶自动驾驶仍处于早期市场阶段，自动驾驶为行业的发展带来更多的可能性，汽车软件付费商业模式正成为可能，当前消费者的自动驾驶认知刚刚萌芽，为自动驾驶功能单独付费的意愿提升空间广阔。国内智能驾驶乘用车共享出行市场规模增长潜力巨大，Robotaxi有望在技术逐渐成熟以及相关法规政策支持下实现快速增长。

人工智能大模型不断升级迭代，生成式人工智能是发展新质生产力的主要阵地，当前大模型已成为产业变革的重要驱动力，政府报告中提出实施“人工智能+”计划，AI渗透带来新的应用场景和需求。OpenAI宣布终止对国内提供服务，国内大模型也不断缩小与海外大模型的差距，未来国内企业和用户更多依赖国产大模型，有望推动国内大模型发展和应用迭代。AI在金融、工业、教育、交通、军事、医疗等领域开始落地，伴随AI应用落地扩容，算力投资有望与应用生态共振爆发。AI引领技术革命，全球算力竞赛开启，美国GPU禁令将加快算力国产化进程。三中全会强调完善推动新一代信息技术、

人工智能等战略性新兴产业发展政策和治理体系，引导新兴产业健康有序发展，人工智能将成为发展新质生产力和技术进步的重要动力。

《数据二十条》创设了“三权分置”权属理论，并明确提出要推进实施公共数据确权授权机制，为公共数据授权运营奠定了政策基础。自从衡阳数据交易被叫停之后整个行业沉寂了很久，因为商业模式较为不清晰、规章制度不完善，各机构落实没有积极性。近期又开始有政策的逐步落地，数据要素长期看取代土地财政的定位从未动摇，未来依靠财政补贴和政策扶持能够逐渐加快行业的成熟。

控制回撤方面，我尽量选择一些阿尔法属性强的标的，个股集中度较低，配置一篮子股票，分散化解风险，行业集中，个股分散；用个股的阿尔法来享受行业的贝塔。

展望四季度，海外美联储进入降息周期，国内政策已有实质性转变，增量政策仍然可期。当前政策超预期、风险偏好大幅修复和国内外增量资金流入的强反弹行情历史未见，需要机动调整策略顺应市场。在不同市场环境要对应不同的策略，当前的反弹行情是否能成为反转行情还需要看财政后续的增量政策。从宏观看，政策呵护下当前对应着国内经济弱复苏预期的环境，风险偏好提升，从投资时钟角度当前是配置权益资产的最佳时刻。四季度研究驱动基金重点看好核心资产的投资机会。

不同的宏观环境核心资产的定义和内涵也有所不同，随着国内增长中枢的下移，我国经济进入新的发展阶段，由地产和基建拉动经济快速增长的模式转变为依靠改革和技术进步驱动经济高质量增长。经济进入新稳态、加速出清和行业优胜劣汰，龙头企业通过行业整合提升市占率，拥有更强的定价权，并且核心企业也更容易获得融资，加大研发提升技术的领先优势，进一步推动盈利改善形成正向循环。从政策角度来看，新“国九条”强调“严把发行上市准入关”，“严格上市公司持续监管”，强调上市公司重视股东回报，“壳价值”炒作受到抑制，政策引导投资进一步聚焦高质量龙头企业。核心资产不局限于过去的消费和新能源领域，核心资产主要指各个细分行业和领域内具备核心竞争力、财务指标优秀、治理稳健的企业，今年以来多个行业的优质核心资产已经体现出超额收益。三中全会公报及决定确立了未来一段时期国内经济发展方向和改革的重点任务，新质生产力、中国式现代化和改革是三中全会的关键词，新质生产力方向和改革涉及的各个领域将不断涌现出新时代的核心资产。

一方面，我们继续看好符合高质量发展政策导向以及景气度有望持续改善的成长领域投资机会；另一方面，以ETF为主的被动投资的崛起预计将重塑市场的投资生态，A股市场以ETF为代表的被动多头过去三年增加了一万亿元，今年前三季度国内ETF是重要的增量资金来源。中证A500指数即将上市，中证A500指数从各行业选取市值较大、流动性较好的500只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。中证A500指数聚焦行业中性的权重配置思路，引入ESG可持续投资理念与互联互通筛选条件，多维度刻画中国经济转型升级背景下核心资产的整体表现，为境内外中长期资金配置A股提供了多元化选择，重点看好中证A500指数中核心资产的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末天治低碳经济混合基金份额净值为1.0333元，本报告期内，基金份额净值增长率为13.61%，同期业绩比较基准收益率为9.93%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 76,253,483.36 | 91.62 |
| | 其中：股票 | 76,253,483.36 | 91.62 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 304,521.29 | 0.37 |
| | 其中：债券 | 304,521.29 | 0.37 |
| | 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 | 4,660,032.44 | 5.60 |
| 8 | 其他资产 | 2,007,514.19 | 2.41 |
| 9 | 合计 | 83,225,551.28 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 50,032,589.36 | 61.70 |
| 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 | 2,083,806.00 | 2.57 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,452,213.00 | 1.79 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息 技术服务业 | 21,983,275.00 | 27.11 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 701,600.00 | 0.87 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施 管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他 服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 76,253,483.36 | 94.03 |

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 688651 | 盛邦安全 | 217,700 | 6,918,506.00 | 8.53 |
| 2 | 002475 | 立讯精密 | 119,700 | 5,202,162.00 | 6.42 |
| 3 | 002241 | 歌尔股份 | 197,700 | 4,481,859.00 | 5.53 |
| 4 | 002600 | 领益智造 | 507,700 | 3,812,827.00 | 4.70 |
| 5 | 002273 | 水晶光电 | 177,700 | 3,363,861.00 | 4.15 |
| 6 | 002938 | 鹏鼎控股 | 87,700 | 3,137,029.00 | 3.87 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 7 | 600536 | 中国软件 | 67,700 | 2,837,307.00 | 3.50 |
| 8 | 300433 | 蓝思科技 | 127,700 | 2,611,465.00 | 3.22 |
| 9 | 688631 | 莱斯信息 | 35,700 | 2,599,674.00 | 3.21 |
| 10 | 002384 | 东山精密 | 107,700 | 2,535,258.00 | 3.13 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 304,521.29 | 0.38 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 304,521.29 | 0.38 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|-------|------------|--------------|
| 1 | 019733 | 24国债02 | 3,000 | 304,521.29 | 0.38 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，歌尔股份的发行主体在报告编制日前一年内曾受到潍坊市坊子区交通运输局的处罚。东山精密的发行主体在报告编制日前一年内曾受到苏州市吴中区消防救援大队的处罚。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 120,437.61 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,542,691.27 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 344,385.31 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 2,007,514.19 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 78,848,629.19 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 7,967,290.41 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 8,334,918.84 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 78,481,000.76 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

注：报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息**8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录**9.1 备查文件目录**

- 1、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金设立等相关批准文件
- 2、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

9.2 存放地点

天治基金管理有限公司办公地点-上海市云锦路701号西岸智塔东塔19楼。

9.3 查阅方式

网址：www.chinanature.com.cn

天治基金管理有限公司
2024年10月24日