

天治量化核心精选混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：天治基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 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 2020 年 8 月 25 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 2020 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
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.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52

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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天治量化核心精选混合型证券投资基金	
基金简称	天治量化核心精选混合	
基金主代码	006877	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 6 月 11 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	51,265,534.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	天治量化核心精选混合 A	天治量化核心精选混合 C
下属分级基金的交易代码:	006877	006878
报告期末下属分级基金的份额总额	50,680,201.24 份	585,333.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化策略精选股票，在严格控制风险及考虑流动性的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，通过定性与定量相结合的方法，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。本基金量化选股策略主要包括行业内多因子选股模型和公司基本面量化筛选策略，通过以上策略，把握各行业特有的核心逻辑，力求寻找核心优势突出、业务模式清晰、基本面扎实、行业地位稳固、公司治理健康且能够带来长期稳定超额收益的股票，通过量化风险模型进一步控制风险，综合考虑交易成本，最后通过统一的优化器构建股票投资组合。在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向、发行人情况和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术选择个券，选择被价格低估的债券进行投资。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×80%+1 年期定期存款利率（税后）×20%
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。

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(免长途话费)	95599

	用)、021-60374800	
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	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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

基金级别	天治量化核心精选混合 A	天治量化核心精选混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	1,857,560.49	975,971.93
本期利润	5,848,969.92	-1,006,934.72
加权平均基金份额本期利润	0.1136	-0.0414
本期加权平均净值利润率	10.14%	-3.62%
本期基金份额净值增长率	10.31%	10.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	4,243,321.91	65,798.86
期末可供分配基金份额利润	0.0837	0.1124
期末基金资产净值	62,565,493.65	741,800.91
期末基金份额净值	1.2345	1.2673
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	23.45%	26.73%

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

天治量化核心精选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.06%	0.87%	6.29%	0.69%	3.77%	0.18%
过去三个月	17.93%	0.89%	11.02%	0.74%	6.91%	0.15%
过去六个月	10.31%	1.35%	3.54%	1.25%	6.77%	0.10%
过去一年	23.20%	1.03%	9.49%	1.00%	13.71%	0.03%
自基金合同	23.45%	1.00%	14.46%	1.00%	8.99%	0.00%

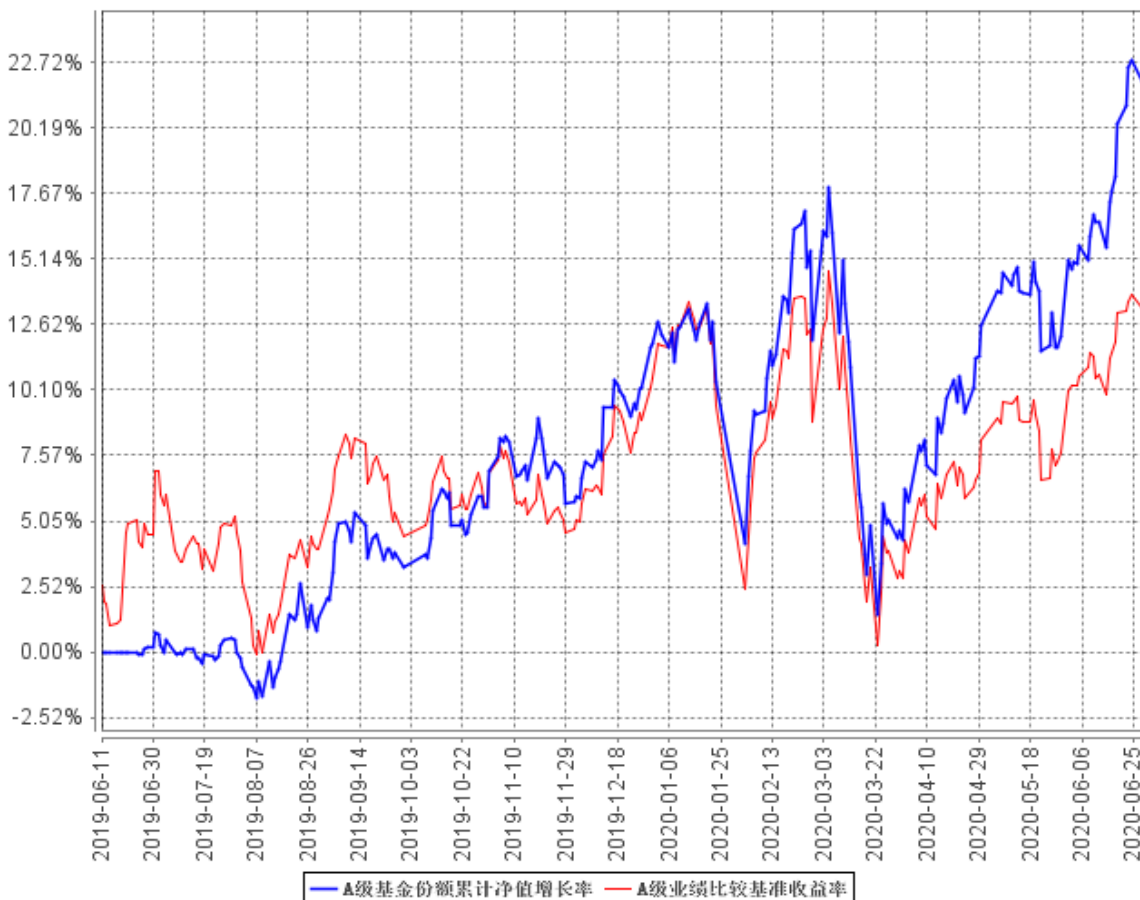
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

天治量化核心精选混合 C

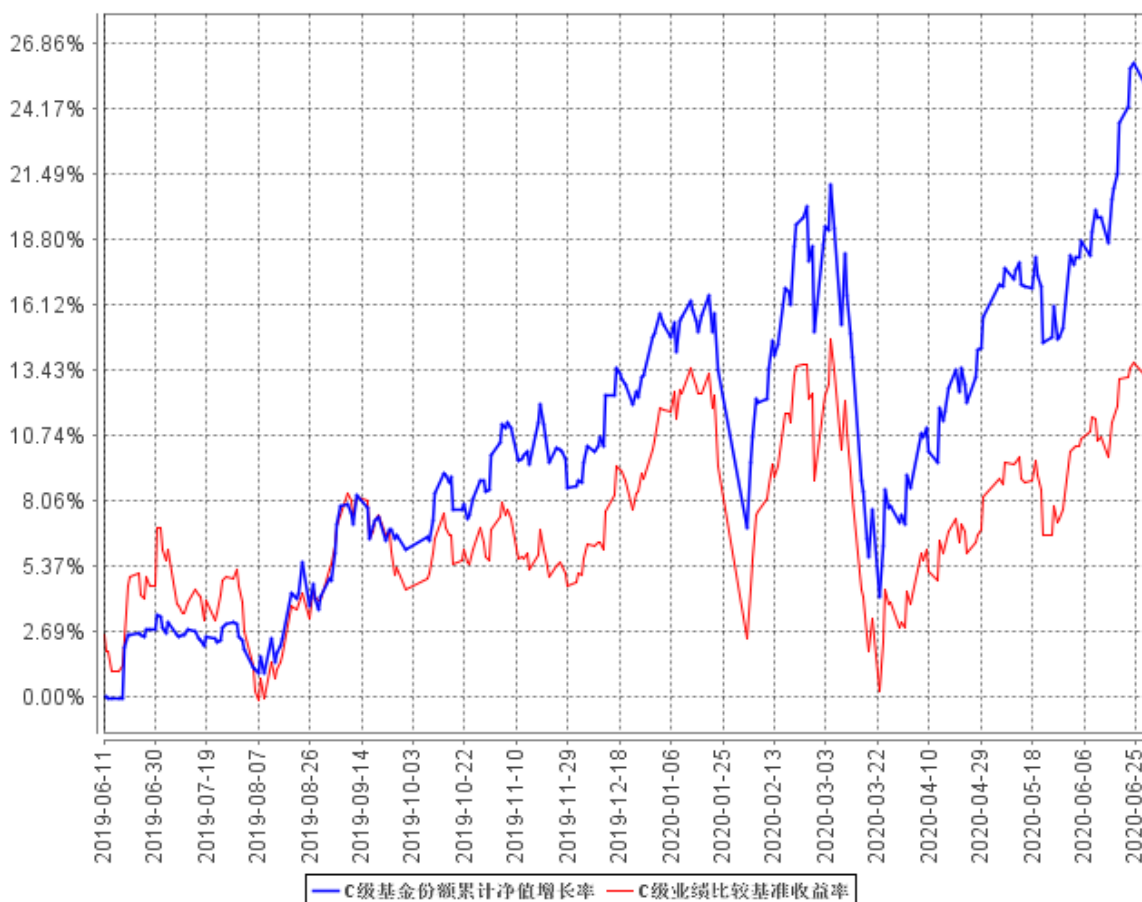
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.05%	0.88%	6.29%	0.69%	3.76%	0.19%
过去三个月	17.90%	0.89%	11.02%	0.74%	6.88%	0.15%
过去六个月	10.24%	1.34%	3.54%	1.25%	6.70%	0.09%
过去一年	23.25%	1.03%	9.49%	1.00%	13.76%	0.03%
自基金合同生效起至今	26.73%	1.01%	14.46%	1.00%	12.27%	0.01%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人——天治基金管理有限公司于 2003 年 5 月成立，注册资本 1.6 亿元，注册地为上海。公司股权结构为：吉林省信托有限责任公司出资 9800 万元，占注册资本的 61.25%；中国吉林森林工业集团有限责任公司出资 6200 万元，占注册资本的 38.75%。截至 2020 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、天治稳健双鑫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、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 11 月 20 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		
TIAN HUAN	量化投资部总监、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	2019 年 6 月 11 日	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。1994 年 9 月至 2000 年 7 月，在建设银行海口市分行担任分行营业部主任职务；2004 年 6 月至 2009 年 12 月，在加拿大 Genus Capital Management 担任基金经理、研究总监和合伙人职务；2010 年 1 月至 2012 年 12 月，在中银基金管理

	基金经 理				有限公司担任投资经理、产品研发副总裁职务；2013年2月至2018年2月，在景顺长城基金管理有限公司担任总经理助理、产品部总监、ETF销售总监职务。
--	----------	--	--	--	--

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《天治量化核心精选混合型证券投资基金基金合同》、《天治量化核心精选混合型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产，为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

报告期内，本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年国内外新冠疫情爆发，各项经济活动和经济指标大幅回落，投资者对国内外疫情和经济基本面双重担忧。国内各项政策积极应对疫情，国内疫情首先在一季度得到有效控制。为使各个行业尽快复产复工，减少疫情对经济和就业的影响，国内货币政策和财政政策保持较大幅度宽松，各项经济活动逐步恢复，经济指标环比回升，投资者对国内疫情和经济基本面的担忧逐步缓解。海外疫情虽然没有实现有效控制，但为了降低疫情对经济和就业的影响，主要经济国家强力推进复产复工。中美科技战愈演愈烈，政治和外交也出现了更加显著的矛盾，外部需求和产业链稳定都受到严重影响。针对外需和产业链，国家积极应对，推出各种政策提振内需，深化改革和扩大开放。

综上所述，2020 年上半年虽然疫情和中美矛盾影响经济和资本市场，但国内政策积极应对，流动性保持宽松，企业盈利逐步环比提升，投资者信心逐步恢复，资本市场在震荡中逐步上行。

本基金 2020 年上半年继续保持较高权益资产配置，优化组合持仓标的，着重配置基本面优质、业绩持续、行业地位稳固、稳定经营的高质量企业为主要投资标的，行业配置比较均衡，收益跟上并超过同期业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.2345 元，C 类份额净值为 1.2673 元；报告期内本基金 A 类份额净值增长率为 10.31%，业绩比较基准收益率为 3.54%，高于同期业绩比较基准收益率 6.77%；C 类份额净值增长率为 10.24%，业绩比较基准收益率为 3.54%，高于同期业绩比较基准收益率 6.70%。

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 2020 年下半年，虽然疫情、中美矛盾和国内外不稳定因素依旧较多，但积极的财政政策和适度宽松的货币政策逐步发力，经济运行指标、企业盈利和资本市场运作将逐步变化，这将是我们在下半年宏观分析的关注要素，并且会根据变化做出适时的调整。

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投资基金行业从业经验。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银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在基金持有人数少于 200 人或基金资产净值低于 5000 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《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一天治基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 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遵规守信、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《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：天治量化核心精选混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,641,491.35	7,146,020.25
结算备付金		11,004,208.80	12,165,282.17
存出保证金		29,314.00	44,263.07
交易性金融资产	6.4.7.2	48,473,612.67	95,956,597.74
其中：股票投资		48,473,612.67	95,956,597.74
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	500,000.00	8,800,000.00
应收证券清算款		24,615.32	201,518.90
应收利息	6.4.7.5	1,385.06	3,612.55
应收股利		-	-
应收申购款		6,000.17	1,299.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		63,680,627.37	124,318,594.39
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		188,832.99	220,159.70
应付管理人报酬		74,753.42	153,845.34
应付托管费		4,983.56	10,256.34
应付销售服务费		153.03	10,965.38
应付交易费用	6.4.7.7	27,505.71	14,529.34
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	77,104.10	110,000.00
负债合计		373,332.81	519,756.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	51,265,534.43	109,063,221.07
未分配利润	6.4.7.10	12,041,760.13	14,735,617.22
所有者权益合计		63,307,294.56	123,798,838.29
负债和所有者权益总计		63,680,627.37	124,318,594.39

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2349 元，基金份额总额 51,265,534.43 份，其中 A 类基金份额净值 1.2345 元，份额总额 50,680,201.24 份；C 类基金份额净值 1.2673 元，份额总额 585,333.19 份。

6.2 利润表

会计主体：天治量化核心精选混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 6 月 11 日(基金 合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		5,906,282.98	916,416.28
1.利息收入		71,430.04	59,443.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	59,704.67	44,178.14
债券利息收入		7.07	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,718.30	15,265.48
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,815,869.39	26,170.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,461,327.03	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	12,775.50	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	341,766.86	26,170.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,008,502.78	141,538.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	10,480.77	689,263.71
减：二、费用		1,064,247.78	131,386.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	639,080.00	96,070.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	42,605.32	6,404.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	27,808.39	7,573.22
4. 交易费用	6.4.7.19	264,232.42	9,676.62
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.03	-
7. 其他费用	6.4.7.20	90,521.62	11,661.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,842,035.20	785,029.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,842,035.20	785,029.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天治量化核心精选混合型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	109,063,221.07	14,735,617.22	123,798,838.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,842,035.20	4,842,035.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-57,797,686.64	-7,535,892.29	-65,333,578.93
其中：1.基金申购款	32,851,816.14	5,097,141.31	37,948,957.45
2.基金赎回款	-90,649,502.78	-12,633,033.60	-103,282,536.38
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-

基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	51,265,534.43	12,041,760.13	63,307,294.56
项目	上年度可比期间 2019年6月11日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	201,182,139.17	-	201,182,139.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	785,029.71	785,029.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-136,566,146.59	-291,405.96	-136,857,552.55
其中:1.基金申购款	990,747.46	-497.84	990,249.62
2.基金赎回款	-137,556,894.05	-290,908.12	-137,847,802.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	64,615,992.58	493,623.75	65,109,616.33

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

天治量化核心精选混合型证券投资基金(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[2018]2229号《关于准予天治量化核心精选混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人天治基金管理有限公司自2019年3月29日至2019年6月6日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证

并出具安永华明（2019）验字第 60467615_B02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2019 年 6 月 11 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 201,156,130.28 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 26,008.89 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 201,182,139.17 元，折合 201,182,139.17 份基金份额，其中 A 类基金份额 50,188,630.19 份，C 类基金份额 150,993,508.98 份。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、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、衍生工具（权证、股指期货等）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：股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×80%+1 年期定期存款利率（税后）×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〈年度和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财

务状况以及 2020 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与 2019 年年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

注：本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

注：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

注：本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 增值税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充

通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（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。

6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	3,641,491.35
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	3,641,491.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	37,444,015.59	48,473,612.67	11,029,597.08
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	37,444,015.59	48,473,612.67	11,029,597.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,371.47
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1.71
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	11.88
合计	1,385.06

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	27,505.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	27,505.71

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	27.10
预提费用	77,077.00
合计	77,104.10

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

天治量化核心精选混合 A		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,727,051.15	51,727,051.15
本期申购	313,379.00	313,379.00
本期赎回(以“-”号填列)	-1,360,228.91	-1,360,228.91
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	50,680,201.24	50,680,201.24

金额单位：人民币元

天治量化核心精选混合 C		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	57,336,169.92	57,336,169.92
本期申购	32,538,437.14	32,538,437.14
本期赎回(以“-”号填列)	-89,289,273.87	-89,289,273.87
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	585,333.19	585,333.19

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

天治量化核心精选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,439,449.79	3,719,671.80	6,159,121.59
本期利润	1,857,560.49	3,991,409.43	5,848,969.92
本期基金份额交易产生的变动数	-53,688.37	-69,110.73	-122,799.10
其中：基金申购款	23,234.35	18,961.77	42,196.12
基金赎回款	-76,922.72	-88,072.50	-164,995.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,243,321.91	7,641,970.50	11,885,292.41

单位：人民币元

天治量化核心精选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,337,507.01	4,238,988.62	8,576,495.63
本期利润	975,971.93	-1,982,906.65	-1,006,934.72
本期基金份额交易产生的变动数	-5,247,680.08	-2,165,413.11	-7,413,093.19
其中：基金申购款	3,264,704.67	1,790,240.52	5,054,945.19
基金赎回款	-8,512,384.75	-3,955,653.63	-12,468,038.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,798.86	90,668.86	156,467.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日

活期存款利息收入	56,969.91
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	2,483.35
其他	251.41
合计	59,704.67

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	102,716,785.87
减：卖出股票成本总额	99,255,458.84
买卖股票差价收入	3,461,327.03

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	12,775.50
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	12,775.50

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	60,382.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	47,600.00
减：应收利息总额	7.40

买卖债券差价收入	12,775.50
----------	-----------

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	341,766.86
基金投资产生的股利收益	-

合计	341,766.86
----	------------

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	2,008,502.78
——股票投资	2,008,502.78
——债券投资	-
——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	2,008,502.78

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	9,443.56
转换费收入	1,037.21
合计	10,480.77

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	264,232.42
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-

合计	264,232.42
----	------------

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	17,404.66
信息披露费	59,672.34
账户维护费	9,000.00
银行汇划费用	4,444.62
合计	90,521.62

6.4.7.21 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

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无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年6月11日(基金合同生效日) 至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	639,080.00	96,070.63
其中：支付销售机构的客户维护费	18,036.70	364.01

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 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 5 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、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 6 月 11 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	42,605.32	6,404.71

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天治量化核心精选混合 A	天治量化核心精选混合 C	合计
天治基金管理有限公司	-	23,874.81	23,874.81
合计	-	23,874.81	23,874.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019 年 6 月 11 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天治量化核心精选混合 A	天治量化核心精选混合 C	合计
天治基金管理有限公司	-	7,573.22	7,573.22
合计	-	7,573.22	7,573.22

注：A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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

日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年6月11日(基金合同生效日)至 2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	1,371.47	56,969.91	7,897.35	44,178.14

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：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票											
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注	

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位: 股)	成本总额	额	
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	
688026	洁特生物	2020年1月15日	2020年7月22日	新股限售	16.49	83.32	4,156	68,532.44	346,277.92	注
688085	三友医疗	2020年3月30日	2020年10月9日	新股限售	20.96	67.62	2,759	57,828.64	186,563.58	注
688090	瑞松科技	2020年2月7日	2020年8月17日	新股限售	27.55	59.45	1,858	51,187.90	110,458.10	注

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

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

注：截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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 2020年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,641,491.35	-	-	-	-	-	3,641,491.35
结算备付金	4,208.80	-	-	-	-	11,000,000.00	11,004,208.80
存出保证金	29,314.00	-	-	-	-	-	29,314.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	48,473,612.67	48,473,612.67
买入返售金融资产	500,000.00	-	-	-	-	-	500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	24,615.32	24,615.32
应收利息	-	-	-	-	-	1,385.06	1,385.06
应收申购款	-	-	-	-	-	6,000.17	6,000.17
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,175,014.15	-	-	-	-	59,505,613.22	63,680,627.37
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	188,832.99	188,832.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	74,753.42	74,753.42
应付托管费	-	-	-	-	-	4,983.56	4,983.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	153.03	153.03
应付交易费用	-	-	-	-	-	27,505.71	27,505.71
其他负债	-	-	-	-	-	77,104.10	77,104.10
负债总计	-	-	-	-	-	373,332.81	373,332.81
利率敏感度缺口	4,175,014.15	-	-	-	-	59,132,280.41	63,307,294.56
上年度末 2019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	7,146,020.25	-	-	-	-	-	7,146,020.25
结算备付金	1,165,282.17	-	-	-	-	11,000,000.00	12,165,282.17
存出保证金	44,263.07	-	-	-	-	-	44,263.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	95,956,597.74	95,956,597.74
买入返售金融资产	8,800,000.00	-	-	-	-	-	8,800,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	201,518.90	201,518.90
应收利息	-	-	-	-	-	3,612.55	3,612.55
应收申购款	-	-	-	-	-	1,299.71	1,299.71
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	17,155,565.49	-	-	-	-	107,163,028.90	124,318,594.39
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	220,159.70	220,159.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	153,845.34	153,845.34
应付托管费	-	-	-	-	-	10,256.34	10,256.34
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,965.38	10,965.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	14,529.34	14,529.34
其他负债	-	-	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	519,756.10	519,756.10
利率敏感度缺口	17,155,565.49	-	-	-	-	-106,643,272.80	123,798,838.29

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期末未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	48,473,612.67	76.57	95,956,597.74	77.51
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	48,473,612.67	76.57	95,956,597.74	77.51

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，只有沪深 300 指数变动时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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	变动+5%	3,283,379.59	3,614,938.58
变动-5%	-3,283,379.59	-3,614,938.58	

注：本基金管理人运用敏感性分析等方法对本基金的其他价格风险进行分析。本表为其他价格风险的敏感性分析。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

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	48,473,612.67	76.12
	其中：股票	48,473,612.67	76.12
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	500,000.00	0.79
	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	14,645,700.15	23.00
8	其他各项资产	61,314.55	0.10
9	合计	63,680,627.37	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	30,399,330.07	48.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,702.00	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,914,442.60	7.76
J	金融业	9,706,309.00	15.33
K	房地产业	835,070.00	1.32
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	913,836.00	1.44

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	1,694,923.00	2.68
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	48,473,612.67	76.57

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,100	5,997,808.00	9.47
2	600276	恒瑞医药	49,560	4,574,388.00	7.23
3	600036	招商银行	91,125	3,072,735.00	4.85
4	002475	立讯精密	52,099	2,675,283.65	4.23
5	600030	中信证券	100,000	2,411,000.00	3.81
6	600585	海螺水泥	39,300	2,079,363.00	3.28
7	000661	长春高新	4,600	2,002,380.00	3.16
8	600183	生益科技	62,500	1,829,375.00	2.89
9	600570	恒生电子	16,880	1,817,976.00	2.87
10	600031	三一重工	94,000	1,763,440.00	2.79
11	300059	东方财富	69,000	1,393,800.00	2.20
12	601318	中国平安	19,400	1,385,160.00	2.19
13	300760	迈瑞医疗	4,500	1,375,650.00	2.17
14	600845	宝信软件	22,000	1,299,760.00	2.05
15	600588	用友网络	26,750	1,179,675.00	1.86
16	300015	爱尔眼科	24,940	1,083,643.00	1.71
17	300750	宁德时代	5,900	1,028,724.00	1.62
18	603259	药明康德	9,460	913,836.00	1.44
19	600309	万华化学	17,500	874,825.00	1.38
20	600048	保利地产	56,500	835,070.00	1.32
21	600745	闻泰科技	6,000	755,700.00	1.19
22	601211	国泰君安	38,900	671,414.00	1.06
23	688023	安恒信息	2,004	617,031.60	0.97

24	300347	泰格医药	6,000	611,280.00	0.97
25	603986	兆易创新	2,560	603,929.60	0.95
26	002271	东方雨虹	13,500	548,505.00	0.87
27	601688	华泰证券	21,000	394,800.00	0.62
28	601689	拓普集团	14,000	390,600.00	0.62
29	600837	海通证券	30,000	377,400.00	0.60
30	601012	隆基股份	9,000	366,570.00	0.58
31	300601	康泰生物	2,200	356,752.00	0.56
32	688026	洁特生物	4,156	346,277.92	0.55
33	000858	五粮液	1,900	325,128.00	0.51
34	600703	三安光电	13,000	325,000.00	0.51
35	002557	洽洽食品	5,000	270,950.00	0.43
36	603501	韦尔股份	1,300	262,535.00	0.41
37	000977	浪潮信息	5,520	216,273.60	0.34
38	300142	沃森生物	3,600	188,496.00	0.30
39	600436	片仔癀	1,100	187,275.00	0.30
40	688085	三友医疗	2,759	186,563.58	0.29
41	002916	深南电路	740	123,964.80	0.20
42	688090	瑞松科技	1,858	110,458.10	0.17
43	600305	恒顺醋业	5,120	94,976.00	0.15
44	300502	新易盛	1,400	88,368.00	0.14
45	603369	今世缘	2,000	79,580.00	0.13
46	300003	乐普医疗	2,000	73,040.00	0.12
47	300782	卓胜微	180	73,038.60	0.12
48	603658	安图生物	400	64,976.00	0.10
49	600872	中炬高新	500	29,265.00	0.05
50	000651	格力电器	500	28,285.00	0.04
51	603288	海天味业	200	24,880.00	0.04
52	300122	智飞生物	200	20,030.00	0.03
53	603087	甘李药业	193	19,357.90	0.03
54	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.03
55	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.02
56	600956	新天绿能	1,925	9,702.00	0.02
57	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01

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	600183	生益科技	1,929,260.10	1.56
2	002475	立讯精密	1,863,388.00	1.51
3	600845	宝信软件	1,794,188.00	1.45
4	300750	宁德时代	1,679,356.00	1.36
5	000063	中兴通讯	1,664,645.00	1.34
6	603986	兆易创新	1,553,189.00	1.25
7	600519	贵州茅台	1,473,081.00	1.19
8	600745	闻泰科技	1,382,217.00	1.12
9	600036	招商银行	1,337,773.00	1.08
10	600837	海通证券	1,239,912.00	1.00
11	600570	恒生电子	1,225,608.00	0.99
12	600585	海螺水泥	1,209,935.00	0.98
13	600031	三一重工	1,178,913.00	0.95
14	603501	韦尔股份	1,166,713.00	0.94
15	300059	东方财富	1,112,472.00	0.90
16	600588	用友网络	1,103,353.00	0.89
17	300760	迈瑞医疗	1,070,093.00	0.86
18	601211	国泰君安	962,222.00	0.78
19	002271	东方雨虹	879,956.00	0.71
20	601012	隆基股份	878,262.00	0.71

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	600036	招商银行	7,634,019.37	6.17
2	600519	贵州茅台	7,294,388.99	5.89
3	601318	中国平安	7,246,669.60	5.85
4	600837	海通证券	2,851,547.00	2.30
5	000063	中兴通讯	2,654,978.00	2.14
6	601601	中国太保	1,926,113.00	1.56
7	601668	中国建筑	1,869,382.00	1.51
8	601211	国泰君安	1,829,719.00	1.48
9	600703	三安光电	1,679,349.00	1.36

10	600031	三一重工	1,568,941.00	1.27
11	600309	万华化学	1,484,454.04	1.20
12	600276	恒瑞医药	1,466,484.00	1.18
13	002475	立讯精密	1,449,193.00	1.17
14	600030	中信证券	1,447,778.00	1.17
15	600104	上汽集团	1,350,302.00	1.09
16	601888	中国中免	1,342,520.00	1.08
17	600000	浦发银行	1,293,657.28	1.04
18	600887	伊利股份	1,241,675.00	1.00
19	600016	民生银行	1,161,992.80	0.94
20	601916	浙商银行	1,136,734.65	0.92

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	49,763,970.99
卖出股票收入（成交）总额	102,716,785.87

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 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本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	29,314.00
2	应收证券清算款	24,615.32
3	应收股利	-
4	应收利息	1,385.06
5	应收申购款	6,000.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,314.55

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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
天治量化核心精选混合 A	60	844,670.02	50,011,000.00	98.68%	669,201.24	1.32%
天治量化核心精选混合 C	187	3,130.12	4,641.23	0.79%	580,691.96	99.21%
合计	247	207,552.77	50,015,641.23	97.56%	1,249,893.20	2.44%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天治量化核心精选混合 A	2,097.41	0.00%
	天治量化核心精选混合 C	0.00	0.00%
	合计	2,097.41	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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持	天治量化核心精选混合 A	0

有本开放式基金	天治量化核心精选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天治量化核心精选混合 A	0
	天治量化核心精选混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	天治量化核心精 选混合 A	天治量化核心精 选混合 C
基金合同生效日（2019 年 6 月 11 日）基金份 额总额	50,188,630.19	150,993,508.98
本报告期期初基金份额总额	51,727,051.15	57,336,169.92
本报告期基金总申购份额	313,379.00	32,538,437.14
减：本报告期基金总赎回份额	1,360,228.91	89,289,273.87
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	50,680,201.24	585,333.19

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，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、托管人的托管业务部门及其相关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	
方正证券	1	107,772,021.81	71.99%	100,368.05	72.40%	-
兴业证券	1	38,049,986.87	25.42%	34,675.04	25.01%	-
中山证券	1	2,015,119.35	1.35%	1,876.67	1.35%	-
川财证券	1	1,869,846.14	1.25%	1,703.98	1.23%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

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

2、基金专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

3、本基金本报告期内新增中山证券 1 个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
方正证券	1,155.70	1.91%	90,000,000.00	87.80%	-	-
兴业证券	59,227.20	98.09%	-	-	-	-
中山证券	-	-	12,500,000.00	12.20%	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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	天治旗下十三只基金 2019 年第 4 季度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 1 月 20 日
2	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加安信证券股份有限公司为代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 1 月 22 日
3	天治基金管理有限公司关于旗下基金业务办理日期调整的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 1 月 30 日
4	天治基金管理有限公司旗下基金参加华安证券定期定额	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 2 月 7 日

	投资手续费率优惠活动的公告		
5	天治基金管理有限公司旗下部分基金参加安信证券费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2020 年 2 月 8 日
6	天治基金管理有限公司旗下基金增加利得基金为代销机构、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	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 3 月 13 日
7	天治基金管理有限公司关于调整旗下部分基金所持“浪潮信息”股票估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报	2020 年 3 月 17 日
8	天治量化核心精选混合型证券投资基金更新的招募说明书（摘要）	上证报	2020 年 3 月 26 日
9	天治基金管理有限公司关于延期披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 3 月 26 日
10	天治旗下十四只基金 2020 年第 1 季度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 4 月 21 日
11	天治旗下十三只基金 2019 年年度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 4 月 30 日
12	天治基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 5 月 9 日
13	天治基金管理有限公司旗下基金参加万联证券费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 5 月 14 日
14	天治基金管理有限公司旗下基金参加上海基煜基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 5 月 22 日
15	天治基金管理有限公司旗下基金参加申万宏源证券有限公司及申万宏源西部证券有限公司费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 6 月 4 日
16	天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2020 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200101-20200102	24,762,282.09	0.00	24,762,282.09	0.00	0.00%
	2	20200101-20200105	24,711,856.19	0.00	24,711,856.19	0.00	0.00%
	3	20200101-20200630	40,009,400.00	0.00	0.00	40,009,400.00	78.04%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金报告期内有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，存在持有人一次性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做出相应调整，减少流动性不佳资产的配置，增加流动性较好资产的配置，目前组合中流动性较好的资产比例较高，20%以上份额持有人一次性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量化核心精选混合型证券投资基金募集的文件
2. 《天治量化核心精选混合型证券投资基金基金合同》
3. 《天治量化核心精选混合型证券投资基金托管协议》
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照
5. 报告期内天治量化核心精选混合型证券投资基金公告的各项原稿

12.2 存放地点

上海市复兴西路 159 号

12.3 查阅方式

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

天治基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日