

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

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。
本报告自2019年1月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: Section (基金基本情况, 基金产品说明) and Content (基金名称, 基金管理人, 基金托管人, etc.)

Table with 2 columns: Section (基金管理人, 基金托管人) and Content (名称, 住所, 法定代表人, etc.)

Table with 2 columns: Section (基金信息披露方式) and Content (信息披露网址, 基金年度报告全文的备查地点)

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: Section (3.1.1 本期主要指标, 3.1.2 本期主要指标) and Content (报告期, 本期, 上期)

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。

注: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,基金利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

注: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孰低(期末余额),不是当期发生数。

3.2 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: Section (3.2.1 基金业绩比较基准, 3.2.2 基金业绩比较基准) and Content (基金业绩比较基准, 基金业绩比较基准)

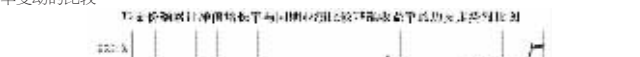


图 1: 基金业绩比较基准与基金业绩比较基准的对比

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
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%。

4.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金助理简介

Table with 2 columns: Name (姓名), Position (职务), Tenure (任职日期), Term (任期年限), Remarks (说明)

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。

注:2.基金经理发生变更,任职日期和行业公会备案日期不一致的,以行业公会备案日期为准。

注:3.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作,严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:4.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:5.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:6.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:7.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:8.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:9.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:10.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:11.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:12.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:13.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:14.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:15.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:16.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:17.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:18.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

注:19.管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》等法律法规,在各方面均符合法律法规和基金合同的要求。

天治稳健双盈债券型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

根据《天治稳健双盈债券型证券投资基金基金合同》约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益最多可分配12次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的20%。

报告期内,本基金共实施分红2次。根据本基金管理人于2019年4月24日发布的分红公告,自2019年4月24日起,本基金向2019年4月25日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每10份基金份额派发红利1.6900元,利润分配合计为人民币145,488,010.74元,其中现金形式发放总额为人民币117,842,618.11元,红利再投资形式发放总额为人民币27,645,392.63元。2019年6月27日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每10份基金份额派发红利1.3600元,利润分配合计为人民币111,652,765.04元,其中现金形式发放总额为人民币108,647,970.27元,红利再投资形式发放总额为人民币3,004,794.77元。

4.8报告期内,本基金不存在持有基金份额少于200人,或本基金资产净值低于5000万元的情形。

5.报告期内,本基金不存在持有基金份额少于200人,或本基金资产净值低于5000万元的情形。

6.4.5.2会计估计变更的说明
本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明
本基金本报告期无重大会计差错更正的内容和更正金额。

6.4.6.6.1 印花税法
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‰;

6.4.6.6.2 增值税
根据财政部、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;

6.4.6.6.3 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.4 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.5 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.6 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.7 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.8 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.9 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.10 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.11 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.12 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.13 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.14 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.15 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.16 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.17 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.18 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.19 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.20 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.21 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.22 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.23 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.24 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.25 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.26 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.27 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.28 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.29 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.30 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.31 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.32 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.33 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.34 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.35 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.36 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.37 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.38 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.39 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.40 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.41 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.42 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.43 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.44 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.45 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.46 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.47 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.48 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.49 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.50 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.51 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.52 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.53 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.54 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.55 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.56 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.57 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.58 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

6.4.6.6.59 金融债利息收入及金融同业往来利息收入
根据财政部、国家税务总局公告2008103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。

7.2 报告期末按行业分类的港股通股票投资持仓组合

注:无
注:无
注:无

Table with 5 columns: Rank (序号), Security Code (股票代码), Security Name (股票名称), Quantity (数量), Public Value (公允价值), and Percentage of Net Assets (占基金资产净值比例)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊载于管理人网站的本半年度报告正文。

7.4 报告期末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

Table with 5 columns: Rank (序号), Security Code (股票代码), Security Name (股票名称), Quantity (数量), Public Value (公允价值), and Percentage of Net Assets (占基金资产净值比例)

注:买入“买入金额”指买入成交金额(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

Table with 5 columns: Rank (序号), Security Code (股票代码), Security Name (股票名称), Quantity (数量), Public Value (公允价值), and Percentage of Net Assets (占基金资产净值比例)

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

7.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: Section (买入股票成本(成交总额), 卖出股票收入(成交总额)) and Amount (金额)

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: Rank (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), Public Value (公允价值), and Percentage of Net Assets (占基金资产净值比例)

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

Table with 4 columns: Rank (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), Public Value (公允价值), and Percentage of Net Assets (占基金资产净值比例)

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 4 columns: Rank (序号), Security Code (股票代码), Security Name (股票名称), Public Value (公允价值), and Percentage of Net Assets (占基金资产净值比例)

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

Table with 4 columns: Rank (序号), Security Code (股票代码), Security Name (股票名称), Public Value (公允价值), and Percentage of Net Assets (占基金资产净值比例)

7.9 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

Table with 4 columns: Rank (序号), Security Code (股票代码), Security Name (股票名称), Public Value (公允价值), and Percentage of Net Assets (占基金资产净值比例)

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资情况
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资损益
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.4 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.5 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。

7.10.6 报告期末本基金投资的期权交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有期权。

7.10.7 报告期末本基金投资的权证交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有权证。

7.10.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有股指期货。