

## 天治基金管理有限公司更正公告

天治基金管理有限公司（以下简称“本公司”）于2016年7月19日在《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》和本公司网站上全文刊登了《天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金2016年第2季度报告》、《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金2016年第2季度报告》、《天治天得利货币市场基金2016年第2季度报告》，相关内容更正如下：

一、关于《天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金2016年第2季度报告》

（一）在“2、基金产品概况”部分，修改如下：

更正前：

基金合同生效日 2008年5月8日

更正后：

基金合同生效日 2016年4月7日

并增加如下内容：

转型前：

基金简称 天治创新先锋混合

交易代码 350005

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2008年5月8日

报告期末基金份额总额 24,102,991.31份

投资目标 专注于投资创新先锋型公司，追求持续稳健的长期回报。

投资策略 本基金以股票品种为主要投资标的，优选通过差异化和低成本不断创新价值、追求持续领先优势的创新先锋型公司，分享其价值创新带来的高成长收益。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

风险收益特征 本基金为具有较高收益、较高风险的混合型基金。

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

(二) 在“3、主要财务指标和基金净值表现”部分修改如下:

更正前内容为:

### 3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标 报告期 ( 2016 年 4 月 1 日 — 2016 年 6 月 30 日 )

1. 本期已实现收益 3,331,282.65
2. 本期利润 3,191,838.58
3. 加权平均基金份额本期利润 0.1332
4. 期末基金资产净值 39,205,187.75
5. 期末基金份额净值 1.6620

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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 净值增长率① 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 8.73% 1.44% 1.78% 0.85% 6.95% 0.59%

#### 3.2.2 自基金合同生效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

更正后内容为:

### 3.1 主要财务指标 (转型后)

单位: 人民币元

主要财务指标 报告期 ( 2016 年 4 月 7 日 — 2016 年 6 月 30 日 )

1. 本期已实现收益 3,419,922.65
2. 本期利润 2,073,222.70
3. 加权平均基金份额本期利润 0.0865
4. 期末基金资产净值 39,205,187.75

5. 期末基金份额净值 1.6620

### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标 报告期（2016年4月1日—2016年4月6日）

1. 本期已实现收益 -88,640.00
2. 本期利润 1,118,615.88
3. 加权平均基金份额本期利润 0.0463
4. 期末基金资产净值 37,963,264.08
5. 期末基金份额净值 1.5750

### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 3.2.1 本报告期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 净值增长率① 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

2016-4-7 至 2016-6-30 5.52% 1.41% 1.13% 0.86% 4.39% 0.55%

#### 3.2.2 自基金合同生效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

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 3.2.1 本报告期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 净值增长率① 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

2016-04-01 至 2016-04-06 3.04% 1.97% 0.86% 0.58% 2.18% 1.39%

#### 3.2.2 自基金合同生效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

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

（三）在“4、管理人报告”中“4.1 基金经理（或基金经理小组）简介”中增加如下内容：

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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

胡耀文 本基金基金经理 2015年6月3日 - 6 金融学硕士研究生，具有基金从业资格。2010年2月至2013年9月就职于东方证券股份有限公司任高级研究员，2013年9月至今就职于天治基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理。

注：1、表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。

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。

在“4.5 报告期内基金的业绩表现”修改如下：

更正前内容为：

报告期末，本基金份额净值为 1.6620 元，报告期内本基金份额净值增长率为 8.73%，业绩比较基准收益率为 1.78%，高于同期业绩比较基准收益率 6.95%。

更正后内容为：

截至转型后报告期末，本报告期（2016年4月7日-2016年6月30日），本基金份额净值为 1.6620 元，报告期内本基金份额净值增长率为 5.52%，业绩比较基准收益率为 1.13%，高于同期业绩比较基准收益率 4.39%。

截至转型前报告期末，本报告期（2016年4月1日-2016年4月6日），本基金份额净值为 1.5750 元，报告期内本基金份额净值增长率为 3.04%，业绩比较基准收益率为 0.86%，高于同期业绩比较基准收益率 2.18%。

（四）对“5、投资组合报告”增加如下内容：

转型前：

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 34,080,510.00 84.89

其中：股票 34,080,510.00 84.89

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 5,872,740.22 14.63

8 其他资产 194,706.31 0.48

9 合计 40,147,956.53 100.00

## 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 4,089,160.00 10.77

C 制造业 19,141,570.00 50.42

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 3,032,900.00 7.99

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 4,864,360.00 12.81

J 金融业 --

K 房地产业 1,208,020.00 3.18

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 1,744,500.00 4.60

S 综合 --

合计 34,080,510.00 89.77

### 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

## 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	300083	劲胜精密	80,000	3,240,800.00	8.54
2	002730	电光科技	70,000	3,112,900.00	8.20
3	600576	万家文化	130,000	3,032,900.00	7.99
4	600475	华光股份	120,000	1,888,800.00	4.98
5	300198	纳川股份	125,000	1,870,000.00	4.93
6	600136	道博股份	30,000	1,744,500.00	4.60
7	300059	东方财富	38,000	1,679,600.00	4.42
8	002612	朗姿股份	20,000	1,270,800.00	3.35
9	002548	金新农	70,000	1,260,000.00	3.32
10	002590	万安科技	50,000	1,223,000.00	3.22

#### 5.4 报告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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

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

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

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

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

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

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

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

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

浙江核新同花顺网络信息股份有限公司开发具有开立证券交易子账户、接受证券交易委托、查询证券交易信息、进行证券和资金的交易结算清算等多种证券业务属性功能的系统。通过该系统，投资者不履行实名开户程序即可进行证券交易。公司在明知客户的经营方式的情况下，仍向不具有经营证券业务资质的客户销售系统、提供相关服务。公司的上述行为违反了《证券法》第一百二十二条的规定，构成《证券法》第一百九十七条所述非法经营证券业务的行为。对于以上行为，该公司于2015年9月7日收到中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚事先告知书》（编号：处罚字[2015]70号）。如公司受到中国证监会行政处罚，并且被认定构成重大违法行为，同花顺（300033）可能被深圳证券交易所实施暂停上市，请广大投资者注意投资风险。

#### 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	144,236.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,501.83
5	应收申购款	43,968.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	194,706.31

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
----	------	------	----------------	--------------	----------

1 002730 电光科技 3,112,900.00 8.20 重大事项  
2 002612 朗姿股份 1,270,800.00 3.35 重大事项

#### 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。

（五）对“6、开放式基金份额变动”修改如下：

更正前内容为：

单位：份

报告期期初基金份额总额 24,186,714.79

报告期期间基金总申购份额 1,971,425.02

减：报告期期间基金总赎回份额 2,568,684.39

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 23,589,455.42

更正后内容为：

#### 6、开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2016年4月7日）基金份额总额 24,102,991.31

报告期期初基金份额总额 -

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 1,914,156.27

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 2,427,692.16

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） -

报告期期末基金份额总额 23,589,455.42

#### 7、开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2008年5月8日）基金份额总额 -

报告期期初基金份额总额 24,186,714.79

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 57,268.75

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 140,992.23

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） -

报告期期末基金份额总额 24,102,991.31



(六)对“7、基金管理人运用固有资金投资本基金情况”增加如下内容:

9、基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前)

9.1 基金管理人持有本基金份额变动情况(转型前)

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。

9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细(转型前)

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。

二、关于《天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告》

(一)在“2、基金产品概况”部分,修改如下:

更正前:

基金合同生效日 2005 年 1 月 12 日

更正后:

基金合同生效日 2016 年 4 月 18 日

并增加如下内容:

转型前:

基金简称 天治品质优选混合

交易代码 350002

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2005 年 1 月 12 日

报告期末基金份额总额 74,404,343.09 份

投资目标 在有效控制风险的前提下,追求中长期稳定且超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略 本基金以股票品种为主要投资标的,以自下而上的股票优选策略为主,辅以自上而下的类别资产配置、行业资产配置,通过综合运用财务品质、经营品质和市场品质三大评估体系,优选具有长期发展潜力的上市公司股票进行投资,并在投资运作的各个环节实施全面风险预算管理。

业绩比较基准 沪深 300 指数收益率 $\times$ 70%+中证全债指数收益率 $\times$ 30%。

风险收益特征 本基金属于证券投资基金中风险水平适中的品种,在投资管理全过程中严格实施风险预算管理,在明确的风险预算目标范围内追求稳定的超额收

益率。

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

(二) 在“3、主要财务指标和基金净值表现”部分修改如下:

更正前内容为:

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标 报告期 ( 2016 年 4 月 1 日 — 2016 年 6 月 30 日 )

1. 本期已实现收益 -1,425,092.08
2. 本期利润 -1,690,405.74
3. 加权平均基金份额本期利润 -0.0338
4. 期末基金资产净值 33,825,706.18
5. 期末基金份额净值 0.7662

单位: 人民币元

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。

### 3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长率① 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 -4.86% 1.69% -1.23% 0.71% -3.63% 0.98%

3.2.2 自基金合同生效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

更正后内容为:

### 3.1 主要财务指标 (转型后)

单位: 人民币元

主要财务指标 报告期 ( 2016 年 4 月 18 日 — 2016 年 6 月 30 日 )

1. 本期已实现收益 -1, 113, 689. 79
2. 本期利润 -1, 768, 902. 02
3. 加权平均基金份额本期利润 -0. 0398
4. 期末基金资产净值 33, 825, 706. 18
5. 期末基金份额净值 0. 7662

### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标 报告期（2016年4月1日—2016年4月17日）

1. 本期已实现收益 -311, 402. 29
2. 本期利润 78, 496. 28
3. 加权平均基金份额本期利润 0. 0010
4. 期末基金资产净值 59, 992, 162. 49
5. 期末基金份额净值 0. 8063

### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 3.2.1 本报告期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 净值增长率① 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

2016-4-18 至 2016-6-30 -3. 46% 1. 79% -0. 94% 0. 67% -2. 52% 1. 12%

#### 3.2.2 自基金合同生效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

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

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 3.2.1 本报告期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 净值增长率① 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

2016-4-1 至 2016-4-17 0. 14% 1. 13% 1. 07% 0. 68% -0. 93% 0. 45%

#### 3.2.2 自基金合同生效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

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

（三）在“4、管理人报告”中“4.1 基金经理（或基金经理小组）简介”中增加如下内容：

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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

曾海 本基金基金经理 2015年6月12日 - 7 2001年7月至2005年8月就职于上海丝绸（集团）股份有限公司，2005年9月至2006年8月就职于皮尔磁工业自动化贸易（上海）有限公司，2008年7月至2009年2月就职于交银国际控股有限公司任研究员，2009年3月至2011年2月就职于国联证券股份有限公司任研究员，2011年3月至2013年6月就职于光大保德信基金管理有限公司任研究员，2013年9月至今就职于天治基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理。

注：1、表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。

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。

在“4.5 报告期内基金的业绩表现”修改如下：

更正前内容为：

报告期末，本基金份额净值为0.7662元，报告期内本基金份额净值下跌4.86%，业绩比较基准收益率为-1.23%，低于同期业绩比较基准收益率3.63%。

更正后内容为：

截至转型后报告期末，本报告期（2016年4月18日-2016年6月30日），本基金份额净值为0.7662元，报告期内本基金份额净值增长率为-3.46%，业绩比较基准收益率为-0.94%，低于业绩比较基准收益率2.52%。

截至转型前报告期末，本报告期（2016年4月1日-2016年4月17日），本基金份额净值为0.8063元，报告期内本基金份额净值增长率为0.14%，业绩比较基准收益率为1.07%，低于业绩比较基准收益率0.93%。

（四）对“5、投资组合报告”中“5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明”部分修改如下：

更正前内容为：

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

更正后内容为：

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

流通受限情况说明

- |   |        |      |              |      |      |
|---|--------|------|--------------|------|------|
| 1 | 600576 | 万家文化 | 2,834,000.00 | 8.38 | 重大事项 |
| 2 | 000002 | 万科A  | 1,820,000.00 | 5.38 | 重大事项 |
| 3 | 002355 | 兴民钢圈 | 1,054,500.00 | 3.12 | 重大事项 |
| 4 | 300038 | 梅泰诺  | 1,264,500.00 | 3.74 | 重大事项 |
| 5 | 300323 | 华灿光电 | 1,870,000.00 | 5.53 | 重大事项 |

并增加如下内容：

转型前：

#### 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 51,640,199.98 83.88

其中：股票 51,640,199.98 83.88

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 9,381,675.08 15.24

8 其他资产 542,951.04 0.88

9 合计 61,564,826.10 100.00

#### 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	23,792,050.00	39.65
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	3,018,600.00	5.03
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	12,567,136.84	20.95
J 金融业	3,973,423.14	6.62
K 房地产业	4,710,240.00	7.85
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	3,578,750.00	5.97
S 综合	--	--
合计	51,640,199.98	86.07

### 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 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	002730	电光科技	80,000	3,564,000.00	5.94
2	600576	万家文化	130,000	3,018,600.00	5.03
3	300073	当升科技	70,000	2,422,700.00	4.04
4	300059	东方财富	50,000	2,264,500.00	3.77
5	601688	华泰证券	119,946	2,169,823.14	3.62
6	300168	万达信息	70,000	1,969,800.00	3.28
7	000002	万科A	100,000	1,962,000.00	3.27
8	002590	万安科技	70,000	1,894,200.00	3.16
9	300196	长海股份	50,000	1,850,000.00	3.08

10 600837 海通证券 120,000 1,803,600.00 3.01

#### 5.4 报告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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

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

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

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

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

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

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

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

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。

##### 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 165,645.11
- 2 应收证券清算款 359,129.78
- 3 应收股利 -
- 4 应收利息 11,566.40
- 5 应收申购款 6,609.75
- 6 其他应收款 -
- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 542,951.04

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

流通受限情况说明

- 1 600576 万家文化 3,018,600.00 5.03 重大事项
- 2 000002 万科A 1,962,000.00 3.27 重大事项

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。

(五) 对“6、开放式基金份额变动”修改如下：

更正前内容为：

单位：份

报告期期初基金份额总额 80,720,995.69

报告期期间基金总申购份额 1,511,508.17

减：报告期期间基金总赎回份额 38,086,237.11

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 44,146,266.75

更正后内容为：

6、开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2016年4月18日）基金份额总额 74,404,343.09



报告期期初基金份额总额 -

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 1,293,180.74

减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 31,551,257.08

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) -

报告期期末基金份额总额 44,146,266.75

#### 7、开放式基金份额变动(转型前)

单位:份

报告期期初基金份额总额 80,720,995.69

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 218,327.43

减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 6,534,980.03

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) -

报告期期末基金份额总额 74,404,343.09

(六)对“7、基金管理人运用固有资金投资本基金情况”增加如下内容:

#### 9、基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前)

##### 9.1 基金管理人持有本基金份额变动情况(转型前)

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。

##### 9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细(转型前)

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。

#### 三、关于《天治天得利货币市场基金2016年第2季度报告》

更正了“5、投资组合报告”中“5.6‘影子定价’与‘摊余成本法’确定的基金资产净值的偏离”部分。

更正前内容为:

项目 偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 -

报告期内偏离度的最高值 0.0776%

报告期内偏离度的最低值 0.0197%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0843%

更正后内容为:

项目 偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 -

报告期内偏离度的最高值 0.0776%

报告期内偏离度的最低值 0.0197%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0576%

除以上内容有更正以外，其他内容不变。由此给投资者带来不便，本公司深表歉意！特此公告。

天治基金管理有限公司

2016年8月6日