

# 天治天得利货币市场基金 2016 年半年度报 告

2016 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 债券回购融资情况.....	31
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	31
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	33
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	33
7.8 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.....	33
7.9 投资组合报告附注.....	33
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>34</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	34
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	34
8.4 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的情况.....	35
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>35</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>35</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	35
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.....	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	36
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.....	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	37
10.9 其他重大事件.....	37
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>39</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>39</b>
12.1 备查文件目录.....	39
12.2 存放地点.....	40
12.3 查阅方式.....	40

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天治天得利货币市场基金
基金简称	天治天得利货币
场内简称	-
基金主代码	350004
交易代码	350004
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 7 月 5 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
报告期末基金份额总额	2,911,692,417.98 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在充分重视本金安全的前提下,确保基金资产的高流动性,追求稳健的当期收益。
投资策略	本基金以短期金融工具为投资对象,依据宏观经济、货币政策、资金供求决定的市场利率变动预期,综合考虑投资对象的收益性、流动性和风险性,进行自上而下与自下而上相结合的积极投资组合管理,保障本金安全性和资产流动性,追求稳健的当期收益。
业绩比较基准	银行 6 个月定期储蓄存款利率(税后)。
风险收益特征	货币市场基金投资于短期金融工具。由于短期国债、金融债、央行票据等主要投资品种信用等级高,利率风险小,因而本基金安全性高,流动性强,收益稳健。货币市场基金是证券投资基金中风险较低的品种,长期看风险和预期收益低于股票基金、混合基金、债券基金。

### 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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	尹维忠	罗菲菲
	联系电话	021-60374975	010-58560666

	电子邮箱	yinwz@chinanature.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-098-4800（免长途通话费用）、021-34064800	95568
传真		021-60374934	010-58560798
注册地址		上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室	北京市西城区复兴门内大街 2 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 2 号
邮政编码		200031	100031
法定代表人		赵玉彪	洪崎

## 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.chinanature.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	11,009,367.50
本期利润	11,009,367.50
本期净值收益率	1.1127%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	2,911,692,417.98
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	36.6795%

注：基金利润分配是按日结转份额。

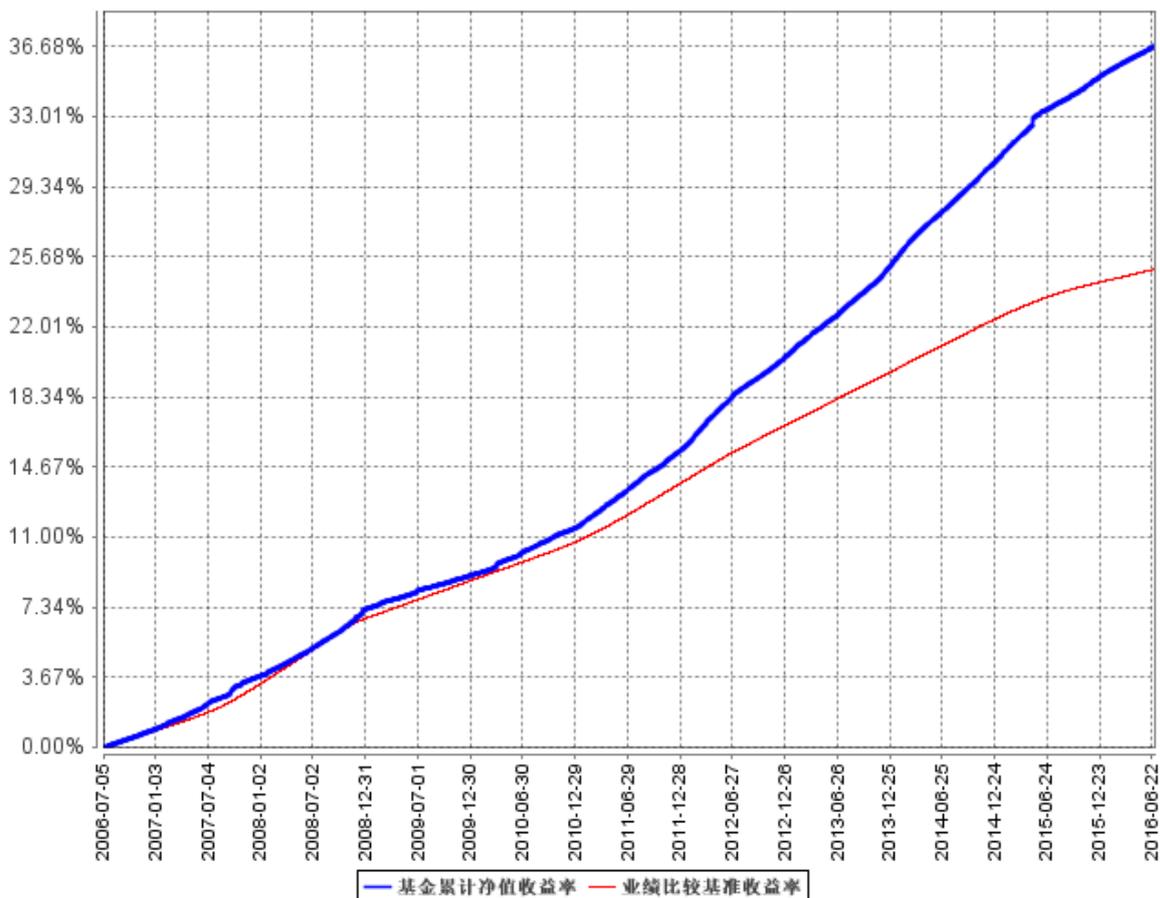
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.1847%	0.0012%	0.1068%	0.0000%	0.0779%	0.0012%
过去三个月	0.5362%	0.0010%	0.3241%	0.0000%	0.2121%	0.0010%
过去六个月	1.1127%	0.0009%	0.6482%	0.0000%	0.4645%	0.0009%
过去一年	2.4419%	0.0035%	1.4207%	0.0005%	1.0212%	0.0030%
过去三年	11.4230%	0.0061%	6.7488%	0.0017%	4.6742%	0.0044%
自基金合同生效起至今	36.6795%	0.0069%	25.0137%	0.0018%	11.6658%	0.0051%

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

基金累计净值收益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 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下共有十只开放式基金，除本基金外，另外九只基金——天治稳健双盈债券型证券投资基金、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）、天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）、天治财富增长证券投资基金、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）、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、天治成长精选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的基金合同（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）分别于 2008 年 11 月 5 日、2016 年 4 月 18 日、2006 年 1 月 20 日、2004 年 6 月 29 日、2016 年 4 月 7 日、2009 年 7 月 15 日、2011 年 8 月 4 日、2013 年 6 月 4 日、2015 年 6 月 9 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		
向桂英	本基金基金经理。	2015 年 3 月 16 日	-	5	硕士研究生，具有基金从业资格，历任本公司交易员、交易部副总监，现任本基金的基金经理。

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。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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《天治天得利货币市场基金基金合同》、《天治天得利货币市场基金招募说明书》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。本基金报告期内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，本基金管理人管理的所有投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易的情形，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

2016 年上半年债券市场收益率呈现震荡走势，资金面总体平稳。一季末，由于 MPA 监管要求，资金面出现阶段性紧张。由于信用风险继续加剧，在报告期内，我们减少了短融融资券的投资，主要以同业存款、同业存单、逆回购等现金类投资为主，在资金偏紧的时点，我们加仓了长期同业存单，为组合贡献了正收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值收益率为 1.1127%，业绩比较基准收益率为 0.6482%，高于同期业绩比较基准收益率 0.4645 个百分点。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济继续处在 L 型的通道中，虽然制造业和房地产投资增速有所下滑，但基建投资在持续发力，同时，由于消费升级，第三产业对经济的贡献在进一步加大，故 GDP 增速大幅降低的概率较小。通胀方面，由于近期多地出现洪灾，蔬菜价格上涨，虽然母猪存栏量开始回升，前期猪肉价格已经开始回落，但由于本次洪灾持续时间较长，蓄类供给将会减少，肉类价

格将继续维持在高位，从而推升 CPI 食品项增速，由于 CPI 去年三季度基数较高，基数效应将降低 CPI 增速，综合来看，下半年 CPI 将取决于本次洪灾的持续时间和破坏力，这将给通胀预期带来一定的不确定性。

流动性方面，上半年总体流动较为宽松，通过公开市场操作稳定市场预期，灵活有度。中国央行调查统计司司长盛松成表示：“现在货币政策有点陷入流动性陷阱现象”，由此，我们认为，货币政策进一步放松的概率在减少。但为了降低企业的融资成本，央行有意控制资金成本上行，故下半年流动性总体处于宽松的态势。

随着信用风险的爆发，信用债个券分化愈演愈烈，债券市场收益率将继续呈现两极分化的态势。精选个券，防范信用风险依然是重中之重。

#### 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、金融工程小组等，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投资管理部以及金融工程小组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，与金融工程小组一同根据估值模型、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

本基金的基金合同约定：年度收益结转选择红利再投方式分配；本期已结转收益为 11,009,367.50 元，其中以红利再投方式结转入实收基金金额为 10,864,402.44 元；本报告期末计入应付收益科目金额为 144,965.06 元。

#### 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

-

### § 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

本报告期内，本基金托管人在对天治天得利货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人一天治基金管理有限公司在天治天得利货币市场基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本基金的基金合同约定：年度收益结转选择红利再投方式分配；本期已结转收益为 11,009,367.50 元，其中以红利再投方式结转入实收基金金额为 10,864,402.44 元；本报告期末计入应付收益科目金额为 144,965.06 元。

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

由天治天得利货币市场基金管理人一天治基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

### § 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：天治天得利货币市场基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	425,516,941.15	159,242,377.58
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,114,901,962.45	109,953,126.52
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,114,901,962.45	109,953,126.52
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	1,161,804,062.70	104,200,676.30
应收证券清算款		-	31,175,557.38
应收利息	6.4.7.5	7,628,631.14	2,284,450.89
应收股利		-	-
应收申购款		352,368,358.31	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,062,219,955.75	406,856,188.67
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		149,499,725.25	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	10,617.79
应付管理人报酬		354,023.24	120,612.89
应付托管费		107,279.71	36,549.38
应付销售服务费		268,199.43	91,373.43
应付交易费用	6.4.7.7	26,997.83	26,189.39
应交税费		-	-
应付利息		9,572.42	-
应付利润		188,095.31	43,130.25
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	73,644.58	139,000.00
负债合计		150,527,537.77	467,473.13
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,911,692,417.98	406,388,715.54
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,911,692,417.98	406,388,715.54
负债和所有者权益总计		3,062,219,955.75	406,856,188.67

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,911,692,417.98

份。

## 6.2 利润表

会计主体：天治天得利货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		14,962,027.84	11,110,611.66
1.利息收入		15,222,098.25	10,719,809.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,038,673.83	5,068,653.08
债券利息收入		7,167,652.53	3,075,781.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,015,771.89	2,575,375.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-260,070.41	390,801.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-260,070.41	390,801.90
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		3,952,660.34	2,250,925.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,631,840.04	938,109.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	494,496.87	284,275.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,236,242.52	710,688.70
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		492,238.17	215,159.37
其中：卖出回购金融资产支出		492,238.17	215,159.37
6. 其他费用	6.4.7.20	97,842.74	102,692.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		11,009,367.50	8,859,686.06
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		11,009,367.50	8,859,686.06

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：天治天得利货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	406,388,715.54	-	406,388,715.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,009,367.50	11,009,367.50
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）	2,505,303,702.44	-	2,505,303,702.44
其中：1.基金申购款	5,127,054,600.57	-	5,127,054,600.57
2.基金赎回款	-2,621,750,898.13	-	-2,621,750,898.13
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）	-	-11,009,367.50	-11,009,367.50
五、期末所有者权益（基金净值）	2,911,692,417.98	-	2,911,692,417.98
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	294,285,067.34	-	294,285,067.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,859,686.06	8,859,686.06
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）	1,725,001,784.89	-	1,725,001,784.89
其中：1.基金申购款	4,727,177,743.69	-	4,727,177,743.69
2.基金赎回款	-3,002,175,958.80	-	-3,002,175,958.80
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）	-	-8,859,686.06	-8,859,686.06

五、期末所有者权益（基金净值）	2,019,286,852.23	-	2,019,286,852.23
-----------------	------------------	---	------------------

注：报告附注为财务报表的组成部分。

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：

<u>赵玉彪</u>	<u>闫译文</u>	<u>黄宇星</u>
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

天治天得利货币市场基金（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”）证监基金字[2006]94 号文《关于同意天治天得利货币市场基金募集的批复》的核准，由天治基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2006 年 7 月 5 日正式生效，首次设立募集规模为 1,095,807,464.98 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金为货币型基金，投资于国内依法发行、高信用等级、具有一定剩余期限限制的债券、央行票据、债券回购、银行存款以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。具体包括：1、现金；2、通知存款；3、1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；4、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；5、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；6、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据；7、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：银行 6 个月定期储蓄存款利率（税后）。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“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，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》等问题的通知及其他中国证监会颁布的相关规定。

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 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与 2015 年年度报告相一致。

##### **6.4.4.1 会计年度**

-

##### **6.4.4.2 记账本位币**

-

##### **6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

-

##### **6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

-

##### **6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

-

##### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

-

##### **6.4.4.7 实收基金**

-

##### **6.4.4.8 损益平准金**

-

##### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

-

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

-

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

-

#### 6.4.4.12 分部报告

-

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

-

### 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

-

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

-

#### 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的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 1. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，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，继续免征营业税和企业所得税。

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。

#### 2. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

## 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	5,516,941.15
定期存款	420,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	220,000,000.00
存款期限 1 个月内	200,000,000.00
其他存款	-
合计：	425,516,941.15

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	1,114,901,962.45	1,115,883,000.00	981,037.55	0.0337%
	合计	1,114,901,962.45	1,115,883,000.00	981,037.55	0.0337%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/基金资产净值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

### 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 2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	1,161,804,062.70	-
合计	1,161,804,062.70	-

**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 2016年6月30日
应收活期存款利息	887.30
应收定期存款利息	457,430.39
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	6,387,384.01
应收买入返售证券利息	748,669.37
应收申购款利息	34,260.07
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	7,628,631.14

**6.4.7.6 其他资产**

注：无

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	26,997.83
合计	26,997.83

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	73,644.58
合计	73,644.58

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	406,388,715.54	406,388,715.54
本期申购	5,127,054,600.57	5,127,054,600.57
本期赎回(以“-”号填列)	-2,621,750,898.13	-2,621,750,898.13
- 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	2,911,692,417.98	2,911,692,417.98

注：申购含红利再投资、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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	11,009,367.50	-	11,009,367.50
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-11,009,367.50	-	-11,009,367.50
本期末	-	-	-

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	2,899,513.60
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	112,344.31
合计	3,038,673.83

**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**

注：无

**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 2016年1月1日至2016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	-260,070.41
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	-260,070.41

**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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	845,817,675.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	838,808,929.32
减：应收利息总额	7,268,816.79
买卖债券差价收入	-260,070.41

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：无

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：无

**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：无

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无

**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：无

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无

**6.4.7.16 股利收益**

注：无

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

注：无

**6.4.7.18 其他收入**

注：无

**6.4.7.19 交易费用**

注：无

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	24,863.02

信息披露费	39,781.56
账户维护费用	18,000.00
其他	800.00
银行汇划费用	14,398.16
合计	97,842.74

#### 6.4.7.21 分部报告

-

### 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
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

### 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：无

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：无

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：无

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：无

**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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,631,840.04	938,109.13
其中：支付销售机构的客户维护费	33,774.60	59,496.03

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费在基金合同生效后每日计提，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。

**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
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	494,496.87	284,275.54

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：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费在基金合同生效后每日计提，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 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费
天治基金管理有限公司	1,172,585.46
中国民生银行股份有限公司	464.79
合计	1,173,050.25
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费
天治基金管理有限公司	572,921.56
中国民生银行股份有限公司	741.46
合计	573,663.02

注：本基金销售服务费用用于本基金的销售与基金份额持有人服务等。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费在基金合同生效后每日计提，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 2 个工作日内从基金财产中划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休假等，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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

	月 30 日	日
基金合同生效日（2006 年 7 月 5 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	3,076,238.33	-
期间申购/买入总份额	-	3,000,000.00
期间因拆分变动份额	30,142.97	32,898.41
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	3,106,381.30	3,032,898.41
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.11%	0.15%

#### 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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
中国民生银行股份有限公司	5,516,941.15	26,815.92	203,656,916.94	1,088,615.56

#### 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

-

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
10,864,402.44	-	144,965.06	11,009,367.50	-

注：本期累计分配金额里包括 2016 年 6 月 30 日应付利润余额为 127,821.31 元。

## 6.4.12 期末（2016 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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金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

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金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人民币 149,499,725.25 元。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 06 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债券、国债、央行票据等，且通过分散化投资以分散信用风险。

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。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无

**6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易，其余均在银行间同业市场交易。因此，本期末本基金的资产均能及时变现。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

**6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无

**6.4.13.4 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。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

**6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2016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	205,516,941.15	220,000,000.00	-	-	-	-	425,516,941.15

交易性金融资产	499,334,760.55	299,443,663.43	316,123,538.47	-	-	-	1,114,901,962.45
买入返售金融资产	1,101,803,852.70	60,000,210.00	-	-	-	-	1,161,804,062.70
应收利息	-	-	-	-	-	7,628,631.14	7,628,631.14
应收申购款	352,000,000.00	-	-	-	-	368,358.31	352,368,358.31
资产总计	2,158,655,554.40	579,443,873.43	316,123,538.47	-	-	7,996,989.45	3,062,219,955.75
负债							
卖出回购金融资产款	149,499,725.25	-	-	-	-	-	149,499,725.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	354,023.24	354,023.24
应付托管费	-	-	-	-	-	107,279.71	107,279.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	268,199.43	268,199.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	26,997.83	26,997.83
应付利息	-	-	-	-	-	9,572.42	9,572.42
应付利润	-	-	-	-	-	188,095.31	188,095.31
其他负债	-	-	-	-	-	73,644.58	73,644.58
负债总计	149,499,725.25	-	-	-	-	1,027,812.52	150,527,537.77
利率敏感度缺口	2,009,155,829.15	579,443,873.43	316,123,538.47	-	-	6,969,176.93	2,911,692,417.98
上年度末 2015 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	69,242,377.58	90,000,000.00	-	-	-	-	159,242,377.58
交易性金融资产	-	-	109,953,126.52	-	-	-	109,953,126.52
买入返售金融资产	104,200,676.30	-	-	-	-	-	104,200,676.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	31,175,557.38	31,175,557.38
应收利息	-	-	-	-	-	2,284,450.89	2,284,450.89
资产总计	173,443,053.88	90,000,000.00	109,953,126.52	-	-	33,460,008.27	406,856,188.67
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,617.79	10,617.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	120,612.89	120,612.89
应付托管费	-	-	-	-	-	36,549.38	36,549.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	91,373.43	91,373.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	26,189.39	26,189.39
应付利润	-	-	-	-	-	43,130.25	43,130.25
其他负债	-	-	-	-	-	139,000.00	139,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	467,473.13	467,473.13
利率敏感度缺口	173,443,053.88	90,000,000.00	109,953,126.52	-	-	-32,992,535.14	406,388,715.54

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：在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种和证券交易所的债券回购产品，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

##### 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 2016年6月30日		上年度末 2015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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,115,883,000.00	38.32	110,307,000.00	27.14
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	1,115,883,000.00	38.32	110,307,000.00	27.14

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：无

##### 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	固定收益投资	1,114,901,962.45	36.41
	其中：债券	1,114,901,962.45	36.41
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,161,804,062.70	37.94
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	425,516,941.15	13.90
4	其他各项资产	359,996,989.45	11.76
5	合计	3,062,219,955.75	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.80	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	149,499,725.25	5.13
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	47
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	125
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

## 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	62.05	5.13
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	9.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	10.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	6.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	4.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		92.81	5.13

## 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：无

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	150,048,951.77	5.15
	其中：政策性金融债	150,048,951.77	5.15
4	企业债券	179,664,836.29	6.17
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	785,188,174.39	26.97
8	其他	-	-
9	合计	1,114,901,962.45	38.29
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

**7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111611122	16 平安 CD122	2,000,000	199,825,409.20	6.86
2	150419	15 农发 19	1,000,000	100,045,947.25	3.44
3	111607007	16 招行 CD007	1,000,000	99,908,389.27	3.43
4	111610041	16 兴业 CD041	1,000,000	99,833,971.23	3.43
5	111616084	16 上海银行 CD084	1,000,000	99,766,990.85	3.43
6	150219	15 国开 19	500,000	50,003,004.52	1.72
7	041669011	16 南昌市政 CP001	500,000	49,847,282.86	1.71
8	111690751	16 杭州银行 CD027	500,000	49,781,355.42	1.71
9	111610267	16 兴业 CD267	500,000	49,359,627.90	1.70
10	111614077	16 江苏银行 CD077	500,000	49,289,826.55	1.69

注：上表中，“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

**7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离**

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	0.2060%
报告期内偏离度的最低值	0.0197%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0897%

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

注：无

**报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明**

注：无

**7.8 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。

**7.9 投资组合报告附注****7.9.1**

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢

价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

## 7.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

## 7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	7,628,631.14
4	应收申购款	352,368,358.31
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	359,996,989.45

## 7.9.4 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

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
1,500	1,941,128.28	2,877,966,602.06	98.84%	33,725,815.92	1.16%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

注：无

### 8.3 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	17,000.00	0.00%
------------------	-----------	-------

#### 8.4 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的情况

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年7月5日）基金份额总额	1,095,807,464.98
本报告期期初基金份额总额	406,388,715.54
本报告期基金总申购份额	5,127,054,600.57
减：本报告期基金总赎回份额	2,621,750,898.13
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	2,911,692,417.98

## § 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，经天治基金管理有限公司董事会审议通过，聘任吕文龙先生担任公司董事长职务。上述事项已按有关规定报中国基金业协会备案，本基金管理人 2016 年 6 月 21 日在指定媒体及公司网站上刊登了《天治基金管理有限公司关于董事长变更的公告》。

报告期内，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，无涉及本基金管理人、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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

**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	
东北证券	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、本基金本报告期内无租用券商交易单元变更情况。

**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
东北证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：报告期内本基金未发生偏离度超过 0.5%的情况。

### 10.9 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 2016 年 1 月 4 日指数熔断调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 4 日
2	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持万科 A 股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 6 日
3	天治基金关于指数熔断期间暂停申购赎回业务的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 6 日
4	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持文化长城、梅泰诺、朗姿股份股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 7 日
5	天治基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 7 日
6	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持明家科技、光环新网股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 9 日
7	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持凯撒旅游股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 12 日
8	天治天得利货币市场基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 22 日
9	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持吴通控股、陆家嘴股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 1 月 30 日
10	天治天得利货币市场基金“春节”假期前暂停申购、定期定额	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 2 月 3 日

	投资、转换转入业务的公告		
11	天治基金管理有限公司关于基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 2 月 3 日
12	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持金叶珠宝股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 2 月 6 日
13	天治天得利货币市场基金更新的招募说明书(摘要)(2016 年第 1 次更新)	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 2 月 19 日
14	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持中茵股份股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 2 月 24 日
15	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持通源石油股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 2 月 25 日
16	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持中南重工股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 3 月 2 日
17	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持姚记扑克股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 3 月 25 日
18	天治天得利货币市场基金 2015 年年度报告摘要	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 3 月 30 日
19	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持电光科技股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 4 月 1 日
20	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持广生堂股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 4 月 8 日
21	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持万家文化股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 4 月 16 日
22	天治天得利货币市场基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 4 月 21 日
23	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持华灿光电股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 4 月 22 日
24	关于天治基金公司淘宝店关闭申购服务的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 5 月 5 日
25	关于天治基金公司网上交易支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 5 月 5 日
26	天治基金管理有限公司关于调	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 5 月 6 日

	整旗下基金所持恒锋工具股票估值方法的公告		
27	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持康耐特股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 5 月 12 日
28	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持光一科技股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 6 月 3 日
29	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持兴民钢圈股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 6 月 4 日
30	天治天得利货币市场基金“端午”假期前暂停申购、定期定额投资、转换转入业务的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 6 月 6 日
31	天治基金管理有限公司关于在陆金所资管开通基金定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 6 月 8 日
32	天治基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 6 月 21 日
33	天治基金管理有限公司关于调整旗下基金所持苏文科股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体及网站	2016 年 6 月 29 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

-
---

## § 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天得利货币市场基金设立的文件
2. 《天治天得利货币市场基金基金合同》
3. 《天治天得利货币市场基金招募说明书》
4. 《天治天得利货币市场基金托管协议》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
6. 报告期内天治天得利货币市场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](http://www.chinanature.com.cn)

天治基金管理有限公司  
2016 年 8 月 29 日