

# 天治天得利货币市场基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 30 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 2017 年 3 月 23 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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.....	6
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	错误! 未定义书签。
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	39
8.2 债券回购融资情况.....	40
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	40
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
8.6 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.....	42

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	42
8.8 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 .....	43
8.9 投资组合报告附注 .....	43
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
9.3 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 .....	44
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
11.2 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 .....	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
11.4 基金投资策略的改变 .....	45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	45
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	46
11.9 其他重大事件 .....	46
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>错误！未定义书签。</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
13.1 备查文件目录 .....	49
13.2 存放地点 .....	49
13.3 查阅方式 .....	49

## § 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
基金主代码	350004
交易代码	350004
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	558,085,226.44份
基金合同存续期	不定期

### 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	赵正中	罗菲菲
	联系电话	021-60371155	010-58560666
	电子邮箱	zhaozz@chinanature.com.cn	tgbfjdx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-098-4800(免长途通话费用)、021-60374800	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.chinanature.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	22,843,950.90	22,008,582.71	46,289,763.28
本期利润	22,843,950.90	22,008,582.71	46,289,763.28
本期净值收益率	2.2304%	3.4113%	4.3450%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末基金资产净值	558,085,226.44	406,388,715.54	294,285,067.34
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
累计净值收益率	38.1902%	35.1753%	30.7163%

注：基金利润分配是按日结转份额。

### 3.2 基金净值表现

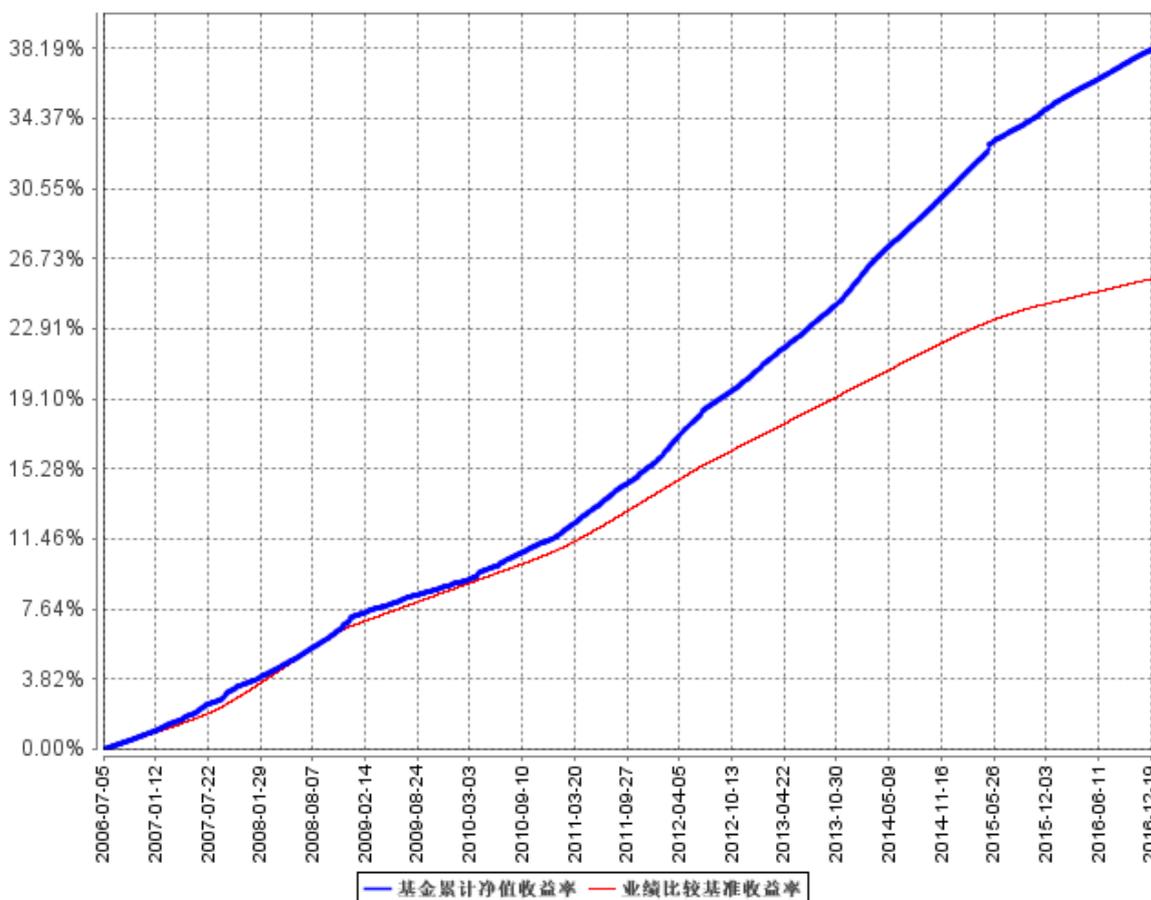
#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.5220%	0.0018%	0.3277%	0.0000%	0.1943%	0.0018%
过去六个月	1.1053%	0.0014%	0.6553%	0.0000%	0.4500%	0.0014%

过去一年	2.2304%	0.0012%	1.3036%	0.0000%	0.9268%	0.0012%
过去三年	10.3111%	0.0062%	5.9926%	0.0018%	4.3185%	0.0044%
过去五年	19.5944%	0.0060%	11.8373%	0.0019%	7.7571%	0.0041%
自基金合同生效起至今	38.1902%	0.0068%	25.6690%	0.0019%	12.5212%	0.0049%

### 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

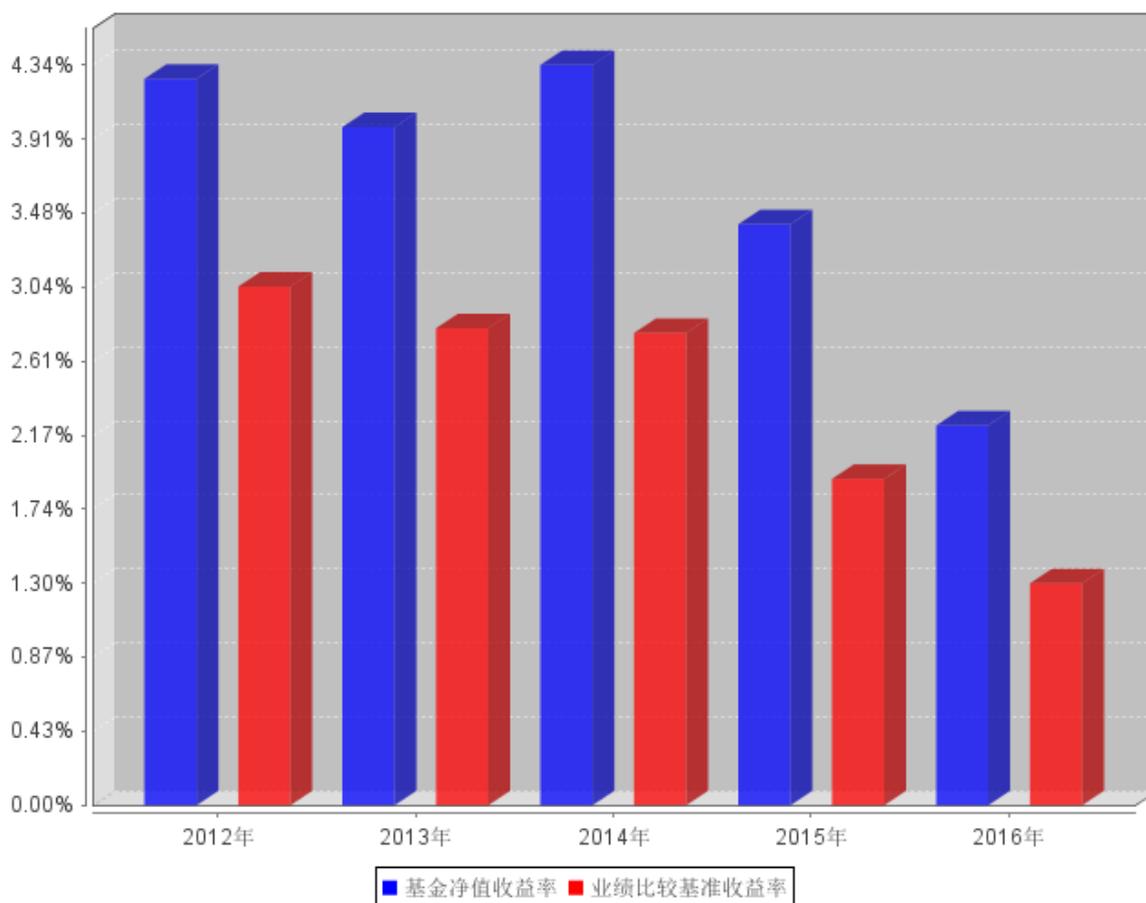
基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期。本基金自 2006 年 7 月 5 日基金合同生效日起三个月内，本基金的各项投资比例已符合基金合同第十二节（三、投资范围和八、投资组合限制）的规定。

## 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2016	22,789,508.56	-	54,442.34	22,843,950.90	注：2016年未计入应付利润科目金额97,572.59元。
2015	22,000,448.81	-	8,133.90	22,008,582.71	注：2015年未计入应付利润科目金额43,130.25元。
2014	46,503,695.19	-	-213,931.91	46,289,763.28	注：2014年末计入应付

					利润科目金额 248,928.26 元。
合计	91,293,652.56	-	-151,355.67	91,142,296.89	

## § 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 12 月 31 日，本基金管理人旗下共有十一只开放式基金，除本基金外，另外十只基金——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）、天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金的基金合同分别于 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、2016 年 7 月 6 日、2013 年 6 月 4 日、2015 年 6 月 9 日、2016 年 12 月 7 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	-	6	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、天治鑫利半年定期开放债券型证

					券投资基金基金经 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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定制定了公司《公平交易制度》。公司公平交易体系涵盖研究分析、授权、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，各环节公平措施简要如下：

公司的内外部报告均通过统一的研究管理平台发布，所有的研究员和投资组合经理均有权通过该平台查看公司所有内外部研究报告。

投资组合经理在授权权限范围内做出投资决策，并负责投资决策的具体实施。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。同时，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度。并在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，交易系统将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合。

公司对银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

公司对银行间市场交易价格异常的控制采用事前审查的方法。回购利率异常指回购利率偏离

同期公允回购利率 30bp 以上；现券交易价格异常指根据交易价格推算出的收益率偏离同期公允收益率 30bp 以上（一年期以上债券为 50bp），其中，货币基金的现券交易价格异常指根据交易价格推算出的收益率偏离同期公允收益率 30bp 以上。

公司风控人员定期对各投资组合进行业绩归因分析，并于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内，不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析。

具体方法如下：

1) 对不同投资组合，根据不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）的每个券种，计算其交易均价；

2) 对一段时间（季度或年度）同一时间窗口的同个券种进行匹配，计算出价差率；

3) 利用统计方法对多个价差率进行统计分析，分析价差率是否显著大于 0。如果某一资产类别观测期间样本数据太少，则不进行统计检验，仅检查对不同时间窗口（如日内、3 日内、5 日内）的价差率是否超过阈值；

4) 价差率不是显著大于 0 的，则不能说明非公平交易；价差率显著大于 0 的，则需要综合其他因素做出判断，比如交易占优势的投资组合是否收益也显著大于交易占劣势的投资组合。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

#### 4.3.3 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，下半年资金面开始波动，特别是 4 季度变得异常紧张，这主要是由于外汇占款持续减少，外加央行在去杠杆的大背景下，并没有继续通过公开市场大量投放基础货币所致。在运行期内，本基金一直本着流动性优先的原则

进行投资，配置了流动性较好的品种，故在本年度保持了较好的流动性。

#### 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 2.2304%，业绩比较基准收益率为 1.3036%，高于同期业绩比较基准收益率 0.9268%。

#### 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 2017 年，目前市场上对 2017 年宏观经济一致预期较强，经济将继续处在 L 型的底部。受政策影响，房地产对经济的贡献在减弱，但制造业近几个月连续好转，由于 PPI 连续正增长，2017 年制造业对经济不形成拖累，受 PPP 项目影响，2017 年基建投资将继续是经济的发力点，总体来看，2017 年国内宏观经济对债券市场的影响较为有限。影响债券市场的更多因素还将来自于通胀和外围经济，值得关注的是 2016 年下半年 CPI 分项中，非食品项在逐步上涨，12 月上涨已达 2%，2012 年以来首次达到 2%。2017 年通胀可能受非食品价格上涨，将高于 2016 年，需要密切关注 PPI 上涨向 CPI 的传导进度。货币政策稳健中性，若通胀有所回升，不排除货币政策更多呈现中性。国外方面，特朗普当选美国总统后，具体将推行怎样的新政，还存在着诸多变数。这对汇率及国内经济影响存在着很大的不确定性，需要重点关注。

流动性方面，2017 年总体流动性估计不太乐观，特别是季度末，银行受 MPA 考核要求，资金面的波动性将加大，控制好负债端的稳定性显得更加重要。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年，本基金管理人内部监察稽核工作继续坚持规范运作、防范风险、维护投资人利益的原则，在进一步完善、优化公司内控制度的基础上，严格依据法律法规和公司内控制度监督前台各部门日常工作，切实防控公司运营和投资组合运作的风险，保障公司稳步发展。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作主要包括以下几个方面：

一、进一步完善、优化公司内控制度，加强监察稽核力度。

报告期内，公司制定或修订了《交易部业务手册》、《银行间债券市场交易管理办法》、《专户投资部管理制度》、《员工投资证券投资基金管理办法》、《投资管理人员利益冲突管理制度》、《规章制度管理办法》、《风险准备金制度》、《天治基金管理有限公司固有资金运作管理制度》、《风险控制制度》、《股指期货风险管理制度》、《股指期货投资管理制度》、《国债期货风险管理制度》、《国

债期货投资管理制度》、《监察稽核制度》、《融资融券及转融通证券出借业务风险管理制度》、《融资融券及转融通证券出借业务投资管理制度》、《特定客户资产投资管理制度》、《特定客户资产管理业务风险控制制度》、《特定客户资产管理业务危机处理制度》、《特定客户资产管理业务记录及档案管理制度》，已经修改待过会的有《天治基金管理有限公司公募基金压力测试制度》、《计算机设备管理办法》、《天治基金专户业务第三方投资顾问机构管理制度》等管理制度。同时，监察稽核部继续严格依据法律法规和公司规章制度独立行使职责，通过定期或不定期检查、专项检查等方式，监督公司各项制度执行情况（监督监察内容包括但不限于投资组合的投资研究、投资决策、交易执行和投资风险、绩效评估等情况、产品研发流程、基金销售、宣传推介、客户服务、信息技术日常处理及其安全情况、基金结算各项业务以及公司财务、人事状况等业务环节的合规情况），及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。

## 二、继续加强投资监控，防范投资运作风险。

报告期内，监察稽核部通过现场检查、电脑实时监控、人员询问、重点抽查等方式，加强事前、事中、事后的风险管理，同时产品创新及量化投资部通过定期对投资组合进行量化风险分析和绩效评估并提供风险分析报告和绩效评估报告等方式进行风险控制，切实贯彻落实公平交易，防范异常交易，确保公司旗下投资组合合法合规运作，切实维护投资人的合法利益。

报告期内，本基金管理人所管理基金的运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，不断完善和优化操作流程，充实和改进内控技术方法与手段，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，防范和控制各种风险，合法合规、诚实信用、勤勉尽责地运作基金财产。

## 4.7 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、产品创新及量化投资部总监等，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、固定收益部以及产品创新及量化投资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，与产品创新及量化投资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。

#### 4.8 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 22,789,508.56 元，其中以红利再投方式结转入实收基金金额为 22,691,935.97 元；本报告期末计入应付收益科目金额为 97,572.59 元。

## § 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。

本基金本期已结转收益为 22,789,508.56 元，其中以红利再投方式结转入实收基金金额为 22,691,935.97 元；本报告期末计入应付收益科目金额为 97,572.59 元。

### 5.3 托管人对本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——天治基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2017）审字第 60467615_B04 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	天治天得利货币市场基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的天治天得利货币市场基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人天治基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了天治天得利货币市场基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	朱宝钦	丁鹏飞
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	55,538,938.17	159,242,377.58
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	319,523,577.14	109,953,126.52
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		319,523,577.14	109,953,126.52
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	180,401,110.60	104,200,676.30
应收证券清算款		-	31,175,557.38
应收利息	7.4.7.5	3,389,293.58	2,284,450.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		558,852,919.49	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 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,118.46	10,617.79
应付管理人报酬		166,108.22	120,612.89
应付托管费		50,335.80	36,549.38
应付销售服务费		125,839.52	91,373.43
应付交易费用	7.4.7.7	24,718.46	26,189.39
应交税费		240,000.00	-
应付利息		-	-
应付利润		97,572.59	43,130.25
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	59,000.00	139,000.00
负债合计		767,693.05	467,473.13
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	7.4.7.9	558,085,226.44	406,388,715.54
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		558,085,226.44	406,388,715.54
负债和所有者权益总计		558,852,919.49	406,856,188.67

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 558,085,226.44 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		30,842,992.20	28,672,400.44
1.利息收入		31,766,998.23	27,528,456.16
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,217,491.90	10,846,311.95
债券利息收入		17,298,410.53	8,752,203.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,251,095.80	7,929,941.17
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-924,006.03	1,143,944.28
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-924,006.03	1,143,944.28
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		7,999,041.30	6,663,817.73
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,415,284.83	2,718,208.80
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,034,934.72	823,699.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,587,336.95	2,059,249.08
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		770,783.18	859,235.98
其中：卖出回购金融资产支出		770,783.18	859,235.98
6. 其他费用	7.4.7.20	190,701.62	203,424.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		22,843,950.90	22,008,582.71

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,843,950.90	22,008,582.71

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	22,843,950.90	22,843,950.90
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）	151,696,510.90	-	151,696,510.90
其中：1. 基金申购款	5,866,006,702.44	-	5,866,006,702.44
2. 基金赎回款	-5,714,310,191.54	-	-5,714,310,191.54
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）	-	-22,843,950.90	-22,843,950.90
五、期末所有者权益（基金净值）	558,085,226.44	-	558,085,226.44
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	-	22,008,582.71	22,008,582.71
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）	112,103,648.20	-	112,103,648.20
其中：1. 基金申购款	8,699,951,480.59	-	8,699,951,480.59

2. 基金赎回款	-8,587,847,832.39	-	-8,587,847,832.39
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）	-	-22,008,582.71	-22,008,582.71
五、期末所有者权益（基金净值）	406,388,715.54	-	406,388,715.54

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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>常永涛</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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)。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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 2 号《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〉》及其他中国证监会及中国证券基金业协会颁布的相关规定。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产分类为交易类金融资产及贷款和应收款项，在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债，以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资；

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利

息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (2) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值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。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

#### 1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

#### 2) 债券投资

基金持有的付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

#### 3) 回购协议

(1) 基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

#### 4) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值；

(3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少

#### 7.4.4.8 损益平准金

无

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定，自 2016 年 2 月 1 日起，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用固有资金予以弥补；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包

含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

(3)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(4)债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日确认,并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账;

(5)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33%的年费率逐日计提;

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率逐日计提;

(3)基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提;

(4)卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)每一基金份额享有同等分配权;

(2)本基金采用 1.00 元固定份额净值交易方式,自基金合同生效之日起每个开放日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人,当日分配的基金净收益参与下一开放日基金收益分配,并每月集中支付,使基金固定份额净值始终保持 1.00 元。基金份额持有人当日应分配收益的精度为 0.01 元,采取小数点后第 3 位去尾原则。收益分配的尾差所形成的基金净收益余额按 0.01 元为单位,于当日进行随机的再次分配;

(3)基金收益支付采用红利再投资方式。如当期累计分配的基金收益为正值,则为基金份额持有人增加相应的基金份额;如当期累计分配的基金收益为负值,则为基金份额持有人缩减相应的基金份额。投资者可通过赎回基金份额获取现金收益;

(4)本基金收益每月集中结转一次,基金合同生效不满一个月不结转;

(5)若基金份额持有人全部赎回基金份额时,基金管理人自动将基金份额持有人账户当前累计

收益全部结转并与赎回款一起支付给基金份额持有人；基金份额持有人部分赎回，账户当前累计收益为正时，不结转账户当前累计收益。账户当前累计收益为负时，按赎回比例结转账户当前累计收益；

(6) 当日申购的基金份额自下一开放日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一开放日起，不享有基金的分配权益；

(7) 在符合相关法律法规及规范性文件的规定，且不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可酌情调整基金收益分配方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过，基金管理人应于实施更改前依照《信息披露办法》和《信息披露特别规定》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告；

(8) 法律法规或监管机构对基金收益分配另有规定的，本基金遵守其规定。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

### 1. 营业税、增值税

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，继续免征营业税；

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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 2. 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[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。

## 3. 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	5,538,938.17	9,242,377.58
定期存款	50,000,000.00	150,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-	50,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	50,000,000.00	100,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	55,538,938.17	159,242,377.58

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 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	319,523,577.14	319,043,400.00	-480,177.14	-0.0860%
	合计	319,523,577.14	319,043,400.00	-480,177.14	-0.0860%
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 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	109,953,126.52	110,307,000.00	353,873.48	0.0871%
	合计	109,953,126.52	110,307,000.00	353,873.48	0.0871%

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	180,401,110.60	-
合计	180,401,110.60	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	

	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	104,200,676.30	-
合计	104,200,676.30	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	5,522.85	798.92
应收定期存款利息	182,430.72	586,555.69
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	2,901,888.99	1,490,498.37
应收买入返售证券利息	299,050.95	201,811.70
应收申购款利息	400.07	4,786.21
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	3,389,293.58	2,284,450.89

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	24,718.46	26,189.39
合计	24,718.46	26,189.39

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
----	--------------------	---------------------

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提审计费用	50,000.00	50,000.00
预提信息披露费用	-	80,000.00
预提账户维护费用	9,000.00	9,000.00
合计	59,000.00	139,000.00

#### 7.4.7.9 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12月31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	5,866,006,702.44	5,866,006,702.44
本期赎回(以“-”号填列)	-5,714,310,191.54	-5,714,310,191.54
- 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	558,085,226.44	558,085,226.44

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	22,843,950.90	-	22,843,950.90
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	-22,843,950.90	-	-22,843,950.90
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日

活期存款利息收入	65,116.81	39,076.51
定期存款利息收入	5,024,097.26	10,456,745.94
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	127,811.50
其他	128,277.83	222,678.00
合计	5,217,491.90	10,846,311.95

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——买卖股票差价收入。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31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	-924,006.03	1,143,944.28
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	-924,006.03	1,143,944.28

##### 7.4.7.13.2 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,910,904,966.19	1,589,603,627.15
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,894,211,029.30	1,562,258,008.07
减：应收利息总额	17,617,942.92	26,201,674.80
买卖债券差价收入	-924,006.03	1,143,944.28

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他业务收入。

### 7.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未产生交易费用。

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
账户维护费用	36,000.00	36,000.00
其他	1,525.00	550.00
银行汇划费用	23,176.62	36,874.21
合计	190,701.62	203,424.21

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除（上述利润分配事项及在）7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

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
吉林省信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国吉林森工业集团有限责任公司	基金管理人的股东
天治北部资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

## 7.4.10 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。

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

注：无

**7.4.10.1.2 债券交易**

注：无

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

注：无

**7.4.10.1.4 权证交易**

注：无

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：无

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,415,284.83	2,718,208.80
其中：支付销售机构的客户维护费	74,910.49	120,436.29

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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,034,934.72	823,699.66

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。

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	2,438,453.19
民生银行	934.83
合计	2,439,388.02
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 12 月 31 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	1,805,077.50
民生银行	1,301.32
合计	1,806,378.82

注：本基金销售服务费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。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31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	68,397.33	3,076,238.33
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	3,144,635.66	3,076,238.33
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.56%	0.76%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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12月31日		2015年1月1日至2015年12月31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	5,538,938.17	310,811.25	9,242,377.58	1,916,126.60

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 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
22,789,508.56	-	54,442.34	22,843,950.90	-

## 7.4.12 ( 2016 年 12 月 31 日 ) 本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 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。

### 7.4.12.2 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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。

### 7.4.13.2 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。

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无

**7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无

**7.4.13.3 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。

**7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无

**7.4.13.4 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。

**7.4.13.4.1 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。

**7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2016年12月	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
-----------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

31 日							
资产							
银行存款	5,538,938.17	50,000,000.00	-	-	-	-	55,538,938.17
交易性金融资产	99,924,244.99	10,005,370.06	209,593,962.09	-	-	-	-319,523,577.14
买入返售金融资产	180,401,110.60	-	-	-	-	-	-180,401,110.60
应收利息	-	-	-	-	-	3,389,293.58	3,389,293.58
资产总计	285,864,293.76	60,005,370.06	209,593,962.09	-	-	3,389,293.58	558,852,919.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,118.46	4,118.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	166,108.22	166,108.22
应付托管费	-	-	-	-	-	50,335.80	50,335.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-	125,839.52	125,839.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	24,718.46	24,718.46
应交税费	-	-	-	-	-	240,000.00	240,000.00
应付利润	-	-	-	-	-	97,572.59	97,572.59
其他负债	-	-	-	-	-	59,000.00	59,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	767,693.05	767,693.05
利率敏感度缺口	285,864,293.76	60,005,370.06	209,593,962.09	-	-	-2,621,600.53	558,085,226.44
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	-	-	-	-	-	91,373.43	91,373.43

务费							
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：无

##### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限

不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 319,523,577.14 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2015 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 109,953,126.52 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

##### 7.4.14.1.2.2 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	319,523,577.14	57.17
	其中：债券	319,523,577.14	57.17
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	180,401,110.60	32.28
	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	55,538,938.17	9.94
4	其他各项资产	3,389,293.58	0.61
5	合计	558,852,919.49	100.00

## 8.2 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	3.68	
	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	-	-
	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

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%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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	76
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	37

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2016 年 1 月 25 日	125	《货币市场基金监督管理办法》自 2016 年 2 月 1 日起施行,根据原《货币市场基金管理暂行规定》,货币市场基金投资组合的平均剩余期限,不得超过 180 天,我司已从 2016 年 2 月 1 起严格按照《货币市场基金监督管理办法》执行,报告期内未有不符合法律法规要求的情况。	-
2	2016 年 1 月 29 日	121	《货币市场基金监督管理办法》自 2016 年	-

			2月1日起施行,根据原《货币市场基金管理暂行规定》,货币市场基金投资组合的平均剩余期限,不得超过180天,我司已从2016年2月1日起严格按照《货币市场基金监督管理办法》执行,报告期内未有不符合法律法规要求的情况。	
--	--	--	---	--

### 8.3.2 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	51.22	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	8.96	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	1.79	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	8.96	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	28.60	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.53	-

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限存续期未超过240天。

### 8.5 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	99,879,192.40	17.90
	其中：政策性金融债	99,879,192.40	17.90
4	企业债券	60,000,062.98	10.75
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	159,644,321.76	28.61
8	其他	-	-
9	合计	319,523,577.14	57.25
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。

### 8.6 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	160204	16 国开 04	500,000	50,000,562.03	8.96
2	041669011	16 南昌市政 CP001	500,000	49,994,692.92	8.96
3	111610021	16 兴业 CD021	500,000	49,923,682.96	8.95
4	160211	16 国开 11	500,000	49,878,630.37	8.94
5	111695890	16 包商银行 CD046	400,000	39,112,867.54	7.01
6	111694698	16 广州农村商业银行 CD099	200,000	19,714,656.50	3.53
7	111695461	16 温州银行 CD093	200,000	19,710,163.08	3.53
8	111696553	16 成都农商银行 CD018	200,000	19,557,517.14	3.50
9	111699026	16 徽商银行 CD103	120,000	11,625,434.54	2.08
10	041651021	16 浙机电 CP001	100,000	10,005,370.06	1.79

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。

### 8.7 “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	-0.1608%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0921%

### 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

## 8.8 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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1

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。

### 8.9.2

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。

### 8.9.3 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	3,389,293.58
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,389,293.58

### 8.9.4 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
1,301	428,966.35	525,804,594.33	94.22%	32,280,632.11	5.78%

### 9.2 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	41,354.25	0.01%

### 9.3 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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 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	5,866,006,702.44
减:本报告期基金总赎回份额	5,714,310,191.54
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	558,085,226.44

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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、中国证券监督管理委员会上海监管局备案，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，基金托管人未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 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

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来，未变更过会计师事务所。

本报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬为 5 万元整。目前的审计机构—安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已提供审计服务的连续年限为自 2006 年 7 月 5 日至今。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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。

### 11.7.2 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	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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绝对值超过 0.5%的情况。

### 11.9 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	上海证券报及公司官网	2016 年 1 月 4 日
2	天治基金关于指数熔断期间暂停申购赎回业务的公告	上海证券报及公司官网	2016 年 1 月 6 日
3	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	上海证券报及公司官网	2016 年 1 月 7 日
4	天治天得利货币市场基金 2015 年第 4 季度报告	上海证券报及公司官网	2016 年 1 月 22 日
5	天治天得利货币市场基金“春节”假期前暂停申购、定期定额投资、转换转入业务的公告	上海证券报及公司官网	2016 年 2 月 3 日

6	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	上海证券报及公司官网	2016 年 2 月 3 日
7	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）	上海证券报及公司官网	2016 年 2 月 19 日
8	天治天得利货币市场基金 2015 年年度报告摘要	上海证券报及公司官网	2016 年 3 月 30 日
9	天治天得利货币市场基金 2016 年第 1 季度报告	上海证券报及公司官网	2016 年 4 月 21 日
10	关于天治基金公司淘宝店关闭申购服务的公告	上海证券报及公司官网	2016 年 5 月 5 日
11	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	上海证券报及公司官网	2016 年 5 月 5 日
12	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	上海证券报及公司官网	2016 年 6 月 6 日
13	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	上海证券报及公司官网	2016 年 6 月 8 日
14	天治基金管理有限公司关于董事长变更的公告	上海证券报及公司官网	2016 年 6 月 21 日
15	天治天得利货币市场基金 2016 年第 2 季度报告	上海证券报及公司官网	2016 年 7 月 19 日
16	天治基金管理有限公司更正公告	上海证券报及公司官网	2016 年 8 月 6 日
17	天治基金管理有限公司关于旗下基金增加大泰金石为代销机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报及公司官网	2016 年 8 月 17 日
18	天治天得利货币市场基金更新的招募说明书摘要（2016 年第 2 次更新）	上海证券报及公司官网	2016 年 8 月 18 日
19	天治基金管理有限公司关于旗下基金增加金观诚为代销机构、开通定期定额投资业务和基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	上海证券报及公司官网	2016 年 8 月 24 日
20	天治天得利货币市场基金 2016 年半年度报告摘要	上海证券报及公司官网	2016 年 8 月 29 日
21	天治天得利货币市场基金“中秋”假期前暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报及公司官网	2016 年 9 月 12 日
22	天治基金管理有限公司旗下开	上海证券报及公司官网	2016 年 9 月 20 日

	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		
23	天治天得利货币市场基金“国庆”假期前暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报及公司官网	2016年9月28日
24	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加钱景财富为代销机构、开通定期定额投资业务和基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	上海证券报及公司官网	2016年9月28日
25	天治天得利货币市场基金 2016 年第 3 季度报告	上海证券报及公司官网	2016年10月26日
26	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	上海证券报及公司官网	2016年11月29日
27	天治基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报及公司官网	2016年12月8日
28	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	上海证券报及公司官网	2016年12月22日
29	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2017 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	上海证券报及公司官网	2016年12月29日
30	天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	上海证券报及公司官网	2016年12月29日
31	天治天得利货币市场基金“元旦”假期前暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报及公司官网	2016年12月29日
32	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报及公司官网	2016年12月30日

## § 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  
2017 年 3 月 30 日