

# 天治天得利货币市场基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 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:2021 年 08 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021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2021年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 债券回购融资情况	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限	39
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	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	41
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	42
7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	42
7.9 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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情况	45
§9 开放式基金份额变动	45

§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	47
10.9 其他重大事件	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 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	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年07月05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	272,327,761.86份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天治天得利货币A	天治天得利货币B
下属分级基金的交易代码	350004	008742
报告期末下属分级基金的份额总额	108,115,571.31份	164,212,190.55份

### 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	tgbfxjdzx@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	单宇		高迎欣

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.chinanature.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

#### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天治基金管理有限公司	上海市复兴西路159号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	天治天得利货币A	天治天得利货币B
本期已实现收益	962,392.54	1,044,189.04
本期利润	962,392.54	1,044,189.04
本期净值收益率	1.0629%	1.1375%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	期末基金资产净值	108,115,571.31
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	累计净值收益率	55.4191%

注：1、基金利润分配是按日结转份额。

2、本基金自2019年12月25日起新增B类基金份额。

### 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

天治天得利货币A

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	0.1674%	0.0036%	0.1068%	0.0000%	0.0606%	0.0036%
过去三个月	0.4799%	0.0029%	0.3241%	0.0000%	0.1558%	0.0029%
过去六个月	1.0629%	0.0032%	0.6447%	0.0000%	0.4182%	0.0032%
过去一年	2.0386%	0.0031%	1.3000%	0.0000%	0.7386%	0.0031%
过去三年	6.7429%	0.0035%	3.9036%	0.0000%	2.8393%	0.0035%

					3%	5%
自基金合同生效起至今	55.4191%	0.0061%	31.5172%	0.0021%	23.9019%	0.0040%

## 天治天得利货币B

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	0.1796%	0.0036%	0.1068%	0.0000%	0.0728%	0.0036%
过去三个月	0.5175%	0.0029%	0.3241%	0.0000%	0.1934%	0.0029%
过去六个月	1.1375%	0.0032%	0.6447%	0.0000%	0.4928%	0.0032%
过去一年	2.1907%	0.0031%	1.3000%	0.0000%	0.8907%	0.0031%
自基金合同生效起至今	3.1954%	0.0034%	1.9732%	0.0000%	1.2222%	0.0034%

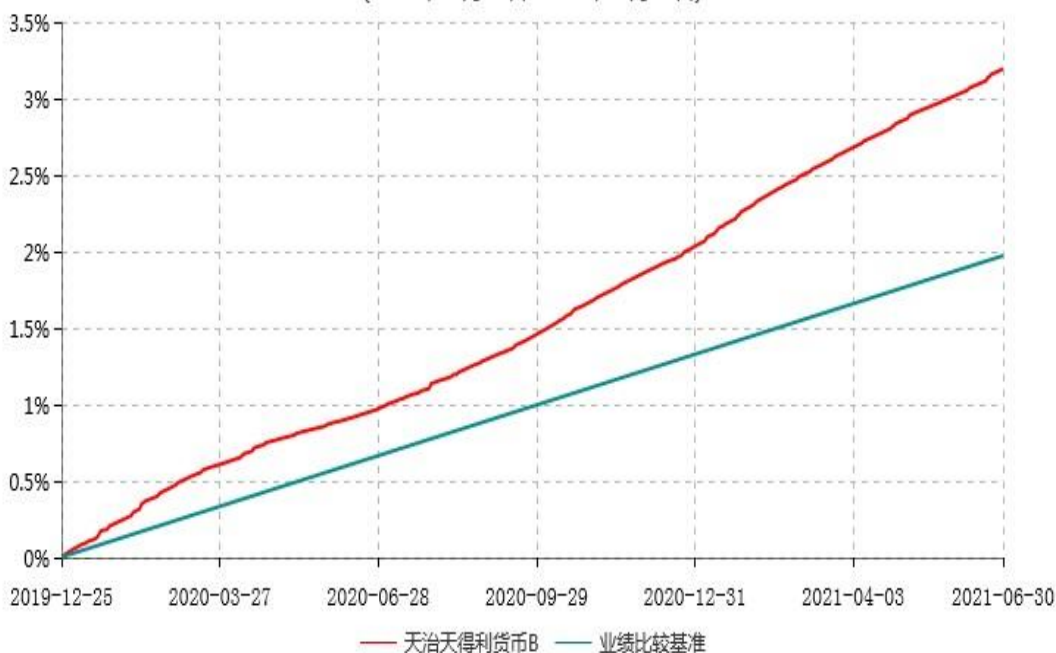
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



天治天得利货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2006年07月05日-2021年06月30日)



天治天得利货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年12月25日-2021年06月30日)



注：本基金自 2019 年 12 月 25 日起新增 B 类基金份额。

#### § 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2021年6月30日，本基金管理人旗下共有十四只开放式基金，除本基金外，另外十三只基金—天治财富增长证券投资基金、天治核心成长混合型证券投资基金（LOF）、天治稳健双盈债券型证券投资基金、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、天治可转债增强债券型证券投资基金、天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金（转型自2011年12月28日生效的天治稳定收益债券型证券投资基金）、天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金（转型自2008年5月8日生效的天治创新先锋混合型证券投资基金）、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金（转型自2005年1月12日生效的天治品质优选混合型证券投资基金）、天治新消费灵活配置混合型证券投资基金（转型自2011年8月4日生效的天治成长精选混合型证券投资基金）、天治鑫利纯债债券型证券投资基金（转型自2016年12月7日生效的天治鑫利半年定期开放债券型证券投资基金）、天治转型升级混合型证券投资基金、天治量化核心精选混合型证券投资基金、天治稳健双鑫债券型证券投资基金分别于2004年6月29日、2006年1月20日、2008年11月5日、2009年7月15日、2013年6月4日、2015年6月9日、2016年4月7日、2016年4月18日、2016年7月6日、2019年3月7日、2019年5月21日、2019年6月11日、2019年11月20日生效。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郝杰	本基金基金经理、天治鑫利纯债债券型证券投资基金基金经理	2019-09-04	-	10年	管理学学士，具有基金从业资格。曾任长信基金管理有限责任公司基金会计、上海浦银安盛资产管理有限公司运营专员、中海基金管理有限公司高级债券交易员。

注：1、基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离任日期为公司对外公告的离任日期；非首任基金经理，任职日期和离任日期分别为公司对外公告的任职日期和离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，未发现有违背公平交易的相关情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

报告期内，本基金管理人未发现异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年上半年债券收益率整体呈现震荡下行趋势。基本面方面，GDP一季度同比增长18.3%，二季度增长7.9%，上半年经济总体稳步复苏，但仍然存在恢复不均衡的问题。通胀方面，猪周期大势未改，拖累CPI处于低位，大宗商品涨价推动PPI大幅上行，5月PPI同比增长9.0%，6月涨幅小幅回落，但依然处于高位，中下游企业利润承压。货币政

策方面，央行延续稳健的货币政策，并逐步回归正常化，流动性整体平稳宽松。今年上半年影响债券市场走势的主要因素为流动性，1月到2月中下旬，央行公开市场操作大额净回笼，市场担忧货币政策收紧，债券收益率小幅上行；2月下旬到6月底，流动性超预期宽松，经济基本面和通胀等因素钝化，债券收益率震荡下行。

报告期内，本基金在保证流动性需求的情况下，结合对资金利率走势的判断，适时调整组合久期和各类资产的配置比例。整体来看，本基金在报告期内为持有人带来了稳定的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末天治天得利货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.0629%，同期业绩比较基准收益率为0.6447%，高于同期业绩比较基准收益率0.4182%；截至报告期末天治天得利货币B基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.1375%，同期业绩比较基准收益率为0.6447%，高于同期业绩比较基准收益率0.4928%。

#### 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，经济大概率平稳增长，经济发展不均衡的问题或将得到缓解。从经济增长的动力来看，疫苗接种速度的差异使得主要经济体疫情恢复并不同步，预计我国制造业出口韧性仍在，但由于去年下半年出口高基数的影响，出口对于经济增速的拉动作用可能会边际减弱；随着居民收入持续改善，收入增速与经济增速之差大幅收窄，居民消费倾向回升，消费持续改善的方向确定性较强；受益于海外疫情并未完全恢复，对海外生产替代效应仍在，制造业投资或将延续增长；房地产调整政策加码，投资增速预计逐步回落；上半年地方债发行速度偏慢，预计三季度将加速发行，但今年地方政府投资意愿大幅下降，预计对基建支持有限。7月初为进一步加强金融对实体经济特别是中小微企业的支持央行全面降准，下半年结构性政策有望继续发力，促进中小微企业的发展，降低社会综合融资成本。

债券市场方面，全面降准后债券收益率快速下行，若后续没有进一步的宽松政策，预计收益率将小幅回升，但难以回到年内高点，下半年债券收益率大概率将窄幅震荡。信用债方面，上半年整体违约率不高，下半年信用违约风险依然需要关注，信用债等级利差的分化或将持续。

基于对以上展望，本基金将在保证流动性和安全性的基础上，通过逆回购、同业存单和短期债券的组合配置，通过积极的投资操作、灵活的组合调整，把握交易窗口期，择优增加较长久期的高收益资产配置，为投资者获取稳定的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人的基金估值和会计核算由基金结算部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制。基金会计均具备基金从业资格。为确保基金资产估值的公平、合理、合规，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了天治基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了有关议事规则。估值委员会成员包括公司投资决策委员会成员、负责基金结算的管理层、监察稽核部总监、产品开发与金融工程部总监等，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对于权益投资部、量化投资部、固定收益部以及产品开发与金融工程部提交的估值模型和估值结果进行论证审核，并签署最终意见。基金经理会参与估值，与产品开发与金融工程部一同根据估值模型、估值程序计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，将估值结果提交公司估值委员会。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定，本基金按日分配收益，每月初例行对上月实现的收益进行收益结转（如遇节假日顺延），收益分配采用红利再投资方式。投资者可通过赎回基金份额获取现金收益。

报告期内，本基金A类份额应分配收益961,311.10元，本基金B类份额应分配收益1,058,430.04元，每日分配，每月结转，符合法律法规的规定和本基金基金合同的约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在基金持有人数少于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，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合规守信、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、基金费用开支及利润分配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。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、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 中期财务会计报告(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：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,074,583.52	276,946.23
结算备付金		12,222.22	154,761.90
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	168,836,200.30	339,592,557.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		168,836,200.30	339,592,557.60
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	81,649,667.48	128,865,009.55
应收证券清算款		-	-

应收利息	6.4.7.5	580,366.48	1,260,572.76
应收股利		-	-
应收申购款		21,359,823.00	10,030,151.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		273,512,863.00	480,179,999.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		1,019,124.58	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,753.34	36,583.72
应付托管费		6,188.32	9,145.92
应付销售服务费		20,942.44	30,000.37
应付交易费用	6.4.7.7	10,650.69	14,065.79
应交税费		2,571.45	1,916.90
应付利息		-	-
应付利润		15,006.86	28,166.42
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	85,863.46	164,000.00
负债合计		1,185,101.14	283,879.12
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	272,327,761.86	479,896,119.92
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		272,327,761.86	479,896,119.92
负债和所有者权益总计		273,512,863.00	480,179,999.04

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.00元，基金份额总额272,327,761.86份，其中A类基金份额净值1.00元，份额总额108,115,571.31份；B类基金份额净值1.00元，份额总额164,212,190.55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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
<b>一、收入</b>		2,518,067.36	2,382,945.38
1. 利息收入		2,447,837.79	2,288,597.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,265.07	18,223.71
债券利息收入		1,799,703.87	1,574,560.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		639,868.85	695,813.10
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		70,229.57	94,348.12
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	70,229.57	94,348.12
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	6.4.7.17	-	-



失以“-”号填列)			
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>		511, 485. 78	538, 206. 90
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	181, 202. 35	202, 174. 31
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	45, 300. 54	50, 543. 56
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	157, 380. 70	162, 732. 89
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	-	-
5. 利息支出		21, 211. 46	16, 662. 30
其中：卖出回购金融资产支出		21, 211. 46	16, 662. 30
6. 税金及附加		1, 711. 62	392. 97
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	104, 679. 11	105, 700. 87
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		2, 006, 581. 58	1, 844, 738. 48
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		2, 006, 581. 58	1, 844, 738. 48

### 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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06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	479, 896, 119. 92	-	479, 896, 119. 92

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,006,581.58	2,006,581.58
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)	-207,568,358.06	-	-207,568,358.06
其中: 1. 基金申购款	387,707,050.68	-	387,707,050.68
2. 基金赎回款	-595,275,408.74	-	-595,275,408.74
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)	-	-2,006,581.58	-2,006,581.58
五、期末所有者权益(基金净值)	272,327,761.86	-	272,327,761.86
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06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)	410,483,009.29	-	410,483,009.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,844,738.48	1,844,738.48
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)	-139,096,740.64	-	-139,096,740.64
其中: 1. 基金申购款	371,672,448.47	-	371,672,448.47
2. 基金赎回款	-510,769,189.11	-	-510,769,189.11

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）	-	-1,844,738.48	-1,844,738.48
五、期末所有者权益（基金净值）	271,386,268.65	-	271,386,268.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

徐克磊

闫译文

黄宇星

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

天治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,由基金管理人天治基金管理有限公司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。根据基金管理人于2019年12月24日发布的《关于天治天得利货币市场基金增加B类基金份额、采用基金份额升降级规则及降低管理费率、托管费率并修改基金合同和托管协议的公告》,自2019年12月25日起,本基金增加B类份额。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。

本基金按照基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量的不同,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费,因此形成不同的基金份额类别。本基金将设A类基金份额和B类基金份额,两类基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和7日年化收益率。

本基金为货币型基金,本基金主要投资于:现金,期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具,以及法律法规或中国证监会、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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》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〈年度和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年06月30日的财务状况以及2021年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与2020年年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

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的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封

封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

#### 6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 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。

### 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	
	2021年06月30日	
活期存款	1,074,583.52	
定期存款	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
合计	1,074,583.52	

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2021年06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	14,207,470.62	14,209,200.00	1,729.38	0.0006
	银行间市场	154,628,729.68	154,686,000.00	57,270.32	0.0210
	合计	168,836,200.30	168,895,200.00	58,999.70	0.0217
资产支持证券		-	-	-	-
合计		168,836,200.30	168,895,200.00	58,999.70	0.0217

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 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000.00	-
银行间市场	71,649,667.48	-
合计	81,649,667.48	-

#### 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 2021年06月30日
应收活期存款利息	841.17
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5.50
应收债券利息	553,655.77
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	25,864.04
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	580,366.48

#### 6.4.7.6 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。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06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	10,650.69
合计	10,650.69

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	17,356.09
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-账户维护费	9,000.00
合计	85,863.46

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 天治天得利货币A

金额单位：人民币元

项目 (天治天得利货币A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	85,194,952.55	85,194,952.55
本期申购	184,472,762.81	184,472,762.81
本期赎回(以“-”号填列)	-161,552,144.05	-161,552,144.05
本期末	108,115,571.31	108,115,571.31

##### 6.4.7.9.2 天治天得利货币B

金额单位：人民币元

项目	本期



(天治天得利货币B)	2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	394,701,167.37	394,701,167.37
本期申购	203,234,287.87	203,234,287.87
本期赎回(以“-”号填列)	-433,723,264.69	-433,723,264.69
本期末	164,212,190.55	164,212,190.55

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

##### 6.4.7.10.1 天治天得利货币A

单位：人民币元

项目 (天治天得利货币A)	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	962,392.54	-	962,392.54
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	-962,392.54	-	-962,392.54
本期末	-	-	-

##### 6.4.7.10.2 天治天得利货币B

单位：人民币元

项目 (天治天得利货币B)	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	1,044,189.04	-	1,044,189.04
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	-1,044,189.04	-	-1,044,189.04
本期末	-	-	-

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	7,384.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	880.39
其他	-
合计	8,265.07

## 6.4.7.12 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。

## 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 2021年01月01日至2021年06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	70,229.57
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	70,229.57

## 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 2021年01月01日至2021年06月30日
----	-------------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	523,267,063.49
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	519,882,180.88
减：应收利息总额	3,314,653.04
买卖债券差价收入	70,229.57

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期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。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

**6.4.7.16 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。

**6.4.7.17 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。

**6.4.7.18 其他收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

**6.4.7.19 交易费用**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无交易费用。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	9,815.65
账户维护费	17,400.00
其他	600.00
合计	104,679.11

**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（“天治基金”）	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（“民生银行”）	基金托管人、基金代销机构
天治北部资产管理有限公司（“天治北部资产”）	基金管理人控制的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

注：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权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

注：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债券交易。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：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债券回购交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	181, 202. 35	202, 174. 31
其中：支付销售机构的客户维护费	34, 663. 64	40, 173. 82

注：2019年12月25日前，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。自2019年12月25日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	45, 300. 54	50, 543. 56

注：2019年12月25日前，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。自2019年12月25日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天治天得利货币A	天治天得利货币B	合计
天治基金管理有限公司	7,230.51	36,523.26	43,753.77
中国民生银行股份有限公司	2,061.60	534.56	2,596.16
合计	9,292.11	37,057.82	46,349.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天治天得利货币A	天治天得利货币B	合计
天治基金管理有限公司	27,334.40	55,008.84	82,343.24
中国民生银行股份有限公司	2,870.72	0.00	2,870.72
合计	30,205.12	55,008.84	85,213.96

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。根据基金管理人于2019年12月24日发布的《关于天治天得利货币市场基金增加B类基金份额、采用基金份额升降级规则及降低管理费率、托管费率并修改基金合同和托管协议的公告》，自2019年12月25日起，本基金增加B类份额。本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%，对于由B类基金份额降级为A类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。B类基金份额的年销售服务费率为0.10%，对于由A类基金份额升级为B类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受B类基金份额的销售服务费率。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

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

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 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

天治天得利货币A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	3,499,921.22	3,436,899.12
报告期间申购/买入总份额	4,046,221.68	29,595.79
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	2,000,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	5,546,142.90	3,466,494.91
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.04%	1.28%

天治天得利货币B

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00



报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%
---------------------	-------	-------

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。

#### 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

份额单位：份

天治天得利货币B

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
天治北部资产管理有限公司	52,204,010.19	19.17%	51,633,208.25	10.76%

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天治天得利A类基金。

#### 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06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	1,074,583.52	7,384.68	582,674.82	14,746.84

#### 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

注：无。

**6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金**

天治天得利货币A

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
961,311.10	-	1,081.44	962,392.54	-

天治天得利货币B

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
1,058,430.04	-	-14,241.00	1,044,189.04	-

**6.4.12 期末（2021年06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2021年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

**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。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的、可在银行间同业市场交易的金融资产工具。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金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 2021年 06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	1,074,583.52	-	-	-	-	-	1,074,583.52
结算备付金	12,222.22	-	-	-	-	-	12,222.22
交易性金融资产	64,107,864.26	64,987,542.05	39,740,793.99	-	-	-	168,836,200.30
买入返售金融资产	81,649,667.48	-	-	-	-	-	81,649,667.48
应收利息	-	-	-	-	-	580,366.48	580,366.48
应收申购款	-	-	-	-	-	21,359,823.00	21,359,823.00
资产总计	146,844,337.48	64,987,542.05	39,740,793.99	-	-	21,940,189.48	273,512,863.00
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,019,124.58	1,019,124.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,753.34	24,753.34
应付托管费	-	-	-	-	-	6,188.32	6,188.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	20,942.44	20,942.44
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,650.69	10,650.69
应交税费	-	-	-	-	-	2,571.45	2,571.45

应付利润	-	-	-	-	-	15,006.86	15,006.86
其他负债	-	-	-	-	-	85,863.46	85,863.46
负债总计	-	-	-	-	-	1,185,101.14	1,185,101.14
利率敏感度缺口	146,844,337.48	64,987,542.05	39,740,793.99	-	-	20,755,088.34	272,327,761.86
上年度末 2020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	276,946.23	-	-	-	-	-	276,946.23
结算备付金	154,761.90	-	-	-	-	-	154,761.90
交易性金融资产	209,866,791.30	129,725,766.30	-	-	-	-	339,592,557.60
买入返售金融资产	128,865,009.55	-	-	-	-	-	128,865,009.55
应收利息	-	-	-	-	-	1,260,572.76	1,260,572.76
应收申购款	-	-	-	-	-	10,030,151.00	10,030,151.00
资产总计	339,163,508.98	129,725,766.30	-	-	-	11,290,723.76	480,179,999.04
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	36,583.72	36,583.72
应付托管费	-	-	-	-	-	9,145.92	9,145.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-	30,000.37	30,000.37
应付交易费用	-	-	-	-	-	14,065.79	14,065.79
应交税费	-	-	-	-	-	1,916.90	1,916.90
应付利润	-	-	-	-	-	28,166.42	28,166.42
其他负债	-	-	-	-	-	164,000.00	164,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	283,879.12	283,879.12
利率敏感度缺	339,163,508.9	129,725,766.3	-	-	-	11,006,844.6	479,896,119.9

口	8	0			4	2
---	---	---	--	--	---	---

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

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	利率上升25个基点	-72,480.94	-71,879.65
	利率下降25个基点	72,480.94	71,879.65

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金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

注：无。

##### 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	168,836,200.30	61.73
	其中：债券	168,836,200.30	61.73
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	81,649,667.48	29.85
	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	1,086,805.74	0.40
4	其他各项资产	21,940,189.48	8.02
5	合计	273,512,863.00	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.26	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例 (%)
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%。

## 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	45
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	49
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	17

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

### 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	40.86	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	25.53	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	11.02	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	3.68	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	10.92	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	92.00	-

### 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：本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过240天的情况。

### 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	14,207,470.62	5.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	65,026,929.27	23.88
6	中期票据	-	-
7	同业存单	89,601,800.41	32.90
8	其他	-	-
9	合计	168,836,200.30	62.00
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名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	112113095	21浙商银行CD095	200,000	19,959,751.74	7.33
2	112009470	20浦发银行CD470	200,000	19,819,532.28	7.28
3	072100083	21东财证券CP003	150,000	14,999,608.54	5.51
4	012101634	21广州金融SCP001	100,000	10,012,424.69	3.68

5	012100985	21紫金矿业SCP002	100,000	10,007,086.72	3.67
6	012100362	21中化工SCP002	100,000	10,003,585.94	3.67
7	012101818	21苏州高新SCP007	100,000	10,003,242.53	3.67
8	072100101	21长城证券CP006	100,000	10,000,980.85	3.67
9	112003128	20农业银行CD128	100,000	9,983,256.01	3.67
10	112010288	20兴业银行CD288	100,000	9,979,525.64	3.66

#### 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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0919%
报告期内偏离度的最低值	-0.0152%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0471%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

#### 7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名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 基金计价方法说明

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末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	580,366.48
4	应收申购款	21,359,823.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	21,940,189.48

### 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

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
天治 天得 利货 币A	4,023	26,874.37	34,236,663.15	31.67 0%	73,878,908.16	68.33%
天治 天得	8	20,526,523.82	164,212,190.55	100.0 00%	0.00	0.00%

利货币B						
合计	4,031	67,558.36	198,448,853.70	72.870%	73,878,908.16	27.13%

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

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	其他机构	52,204,010.19	19.17%
2	保险类机构	50,004,565.59	18.36%
3	券商类机构	20,000,000.00	7.34%
4	其他机构	20,001,152.31	7.34%
5	信托类机构	15,000,864.23	5.51%
6	其他机构	10,000,000.00	3.67%
7	其他机构	7,000,000.00	2.57%
8	保险类机构	5,001,310.15	1.84%
9	信托类机构	5,000,288.08	1.84%
10	其他机构	4,237,181.92	1.56%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天治天得利货币A	370,094.26	0.34%
	天治天得利货币B	-	-
	合计	370,094.26	0.14%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）；

#### 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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	天治天得利货币A	10~50
	天治天得利货币B	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	天治天得利货币A	0
	天治天得利货币B	0
	合计	0

#### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	天治天得利货币A	天治天得利货币B
基金合同生效日(2006年07月05日)基金份额总额	1,095,807,464.98	201,037,693.06
本报告期期初基金份额总额	85,194,952.55	394,701,167.37
本报告期基金总申购份额	184,472,762.81	203,234,287.87
减：本报告期基金总赎回份额	161,552,144.05	433,723,264.69
本报告期期末基金份额总额	108,115,571.31	164,212,190.55

注：本基金自2019年12月25日起新增B类基金份额。

#### § 10 重大事件揭示

##### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，无基金份额持有人大会决议。

##### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

##### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，未改聘会计师事务所。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总额的 比例		购成交 总额的 比例		交总额的 比例		交总额的 比例
东北证 券	14,208,18 0.00	100.0 0%	105,400,00 0.00	100.0 0%	-	-	-	-

### 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绝对值超过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	天治旗下十四只基金2020年第4季度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、 证券日报	2021-01-22
2	天治天得利货币市场基金 “春节”假期前暂停申购、 转换转入、定期定额投资业 务的公告	证券日报	2021-02-08
3	天治旗下十四只基金2020年 年度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、 证券日报	2021-03-30
4	天治天得利货币市场基金 “清明”假期前暂停申购、 转换转入、定期定额投资业 务的公告	证券日报	2021-03-31
5	天治旗下十四只基金2021年 第1季度报告汇总	上证报、中证报、证券时报、 证券日报	2021-04-21
6	天治天得利货币市场基金 “五一”假期前暂停申购、 转换转入、定期定额投资业 务的公告	证券日报	2021-04-28
7	天治基金管理有限公司旗下 开放式基金参加吉林银行基 金申购及定期定额投资手续 费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、 证券日报	2021-05-28
8	天治天得利货币市场基金 “端午”假期前暂停申购、	证券日报	2021-06-09

	转换转入、定期定额投资业务的公告		
9	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加爱建基金为代销机构、开通基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-06-24
10	天治基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加上海基煜基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-06-24
11	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加中信证券、中信期货、中信证券山东、中信证券华南为代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-06-25
12	天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2021-06-30

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210107-20210201;20210204-20210204;20210219-20210629	51,633,208.25	10,570,801.94	10,000,000.00	52,204,010.19	19.17%
产品特有风险							
本基金单一投资者持有的基金份额比例较高, 需要保持足够好的流动性应对集中赎回情况。但本基金以流动性较好的资产为主, 可及时变现, 流动性风险总体可控。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、天治天得利货币市场基金设立等相关批准文件
- 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、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 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  
二〇二一年八月二十七日