

# 天治天得利货币市场基金 2009 年半年度报告（正文）

2009 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

报告送出日期：二〇〇九年八月二十五日

## 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 2009 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2009 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.....	8
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.....	9
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说明.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
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.....	11
5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1	资产负债表.....	12
6.2	利润表.....	14
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4	报表附注.....	16
7	投资组合报告.....	25
7.1	期末基金资产组合情况.....	25
7.2	债券回购融资情况.....	26
7.3	债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明.....	26
7.4	基金投资组合平均剩余期限.....	26
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	27
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.....	27
7.7	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	28
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	28
7.9	投资组合报告附注.....	28

8	基金份额持有人信息.....	29
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	29
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	29
9	开放式基金份额变动.....	29
10	重大事件揭示.....	30
10.1	基金份额持有人大会决议.....	30
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.....	30
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	30
10.4	基金投资策略的改变.....	30
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	30
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	30
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	30
10.8	其他重大事件.....	31
11	备查文件目录.....	32
11.1	备查文件目录.....	32
11.2	存放地点.....	32
11.3	查阅方式.....	32

## 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
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
报告期末基金份额总额	795,167,075.62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	张丽红	辛洁
	联系电话	021-64371155	010-58560666
	电子邮箱	zhanglh@chinanature.com .cn	xinjie@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008864800、021-34064800	95568
传真		021-64713618、 021-64713758	010-58560794
注册地址		上海市延平路 83 号 501-503 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	董文标

## 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	注册登记机构
名称	天治基金管理有限公司
办公地址	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	2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
本期已实现收益	10,029,695.53
本期利润	10,029,695.53
本期净值收益率	0.8695%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年
期末基金资产净值	795,167,075.62
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2009 年

累计净值收益率	8.1666%
---------	---------

注 1：基金利润分配是按日结转份额。

注 2：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

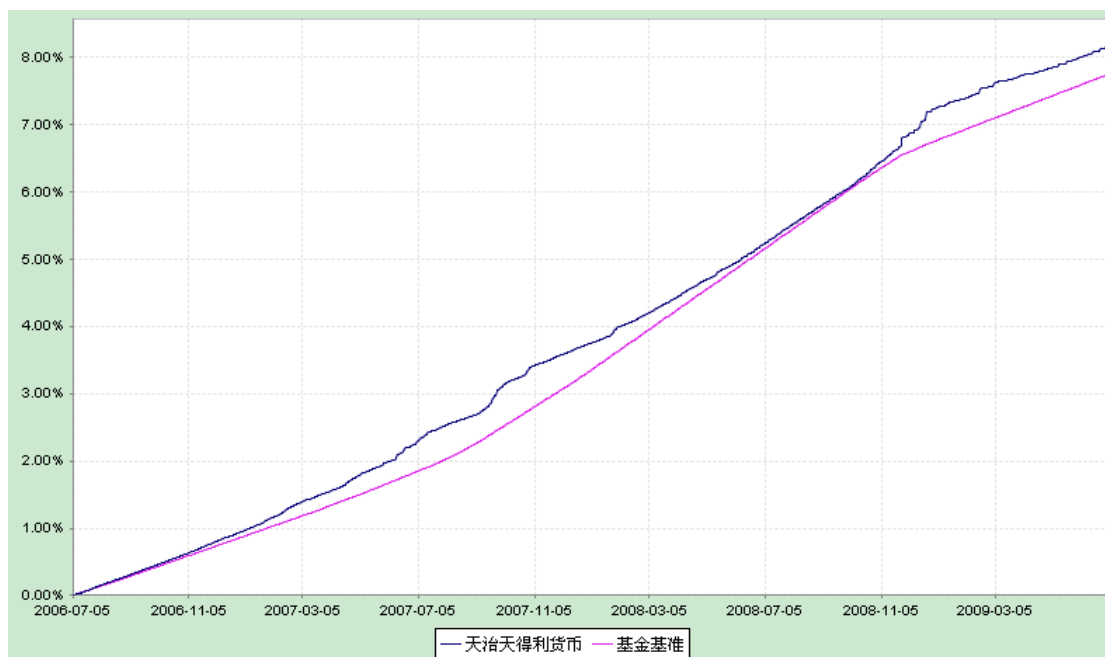
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1805%	0.0084%	0.1627%	0.0000%	0.0178%	0.0084%
过去三个月	0.4302%	0.0069%	0.4936%	0.0000%	-0.0634%	0.0069%
过去六个月	0.8695%	0.0075%	0.9819%	0.0000%	-0.1124%	0.0075%
过去一年	2.8422%	0.0107%	2.6253%	0.0020%	0.2169%	0.0087%
自基金合同生效起至今	8.1666%	0.0071%	7.7299%	0.0021%	0.4367%	0.0050%

#### 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

天治天得利货币市场基金

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 7 月 5 日至 2009 年 6 月 30 日）



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。

## 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 1.3 亿元，注册地为上海。公司股权结构为吉林省信托投资有限责任公司出资 6000 万元，占注册资本的 46.16%；中国吉林森林工业集团有限责任公司出资 5000 万元，占注册资本的 38.46%；吉林市国有资产经营有限责任公司出资 2000 万元，占注册资本的 15.38%。截至本报告期末，本基金管理人旗下共有六只开放式基金，除本基金外，另外五只基金——天治财富增长证券投资基金、天治品质优选混合型证券投资基金、天治核心成长股票型证券投资基金（LOF）、天治创新先锋股票型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金的基金合同分别于 2004 年 6 月 29 日、2005 年 1 月 12 日、2006 年 1 月 20 日、2008 年 5 月 8 日、2008 年 11 月 5 日生效。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贺云 先生	本基金的基金经理,天治稳健双盈债券型证券投资基金的基金经理。	2008-6-30		6 年	经济学学士, 证券从业经验 6 年。曾先后在工商银行上海分行、上海浦发银行资金市场部、万家基金管理有限公司、德国德累斯登银行上海分行任职。2007 年 12 月加入天治基金管理有限公司, 从事证券研究和基金投资管理工作, 现任本基金的基金经理兼天治稳健双盈债券型证券投资基金的基金经理。

注 1: 表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。

注 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

本基金管理人在报告期内, 严格遵守《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定, 勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益, 不存在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》、公司《公平交易制度》及《异常交易监控与报告制度》。

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下没有与本基金投资风格相似的封闭式基金、开放式基金、社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金管理人未发现本基金有涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵和涉嫌利益输送的异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

09 年上半年，国内宏观经济触底回升，但复苏的基础仍不稳固。国务院在多个场合强调要保持宏观政策的连续性和稳定性，在这种大环境下，上半年央行继续实施适度宽松的货币政策。在央行适度宽松的货币政策下，货币市场利率在相当长的时间内保持在非常低的水平，银行间 7 天回购利率在 IPO 重启消息公布前一直维持在 1% 以下，低于按目前利率水平估算的银行综合资金成本。但随着 IPO 的重启，增加了市场对资金的需求，7 天回购利率到 6 月末达到 1.5% 左右的水平，从而带动中短期品种收益率的上升。银行间市场中一年以内的短债收益率平均上升了 30bp，且期限越短的，收益率上升越明显。

截止到上半年新增贷款达到 7.37 万亿，远远高于年初的目标；新增贷款的超常规投放，极大地活跃了实体经济并对经济的复苏起到了积极的推动作用。6 月份 M2 同比增长也攀升到 28.64%，为今年以来同比增长的最高值。从宏观经济层面看，除出口外，投资和消费的各项数据继续保持同比稳定增长。

IPO 的重启不仅推高了货币市场的利率，同时给货币基金带来比较大的赎回压力，我们加大了基金组合的流动性管理，缩短了组合久期，提高了现金比例。货币基金另一投资品种浮息债则表现良好，货币市场利率走高以及对中期通胀预期的上升均提高了浮息债的吸引力。由于货币基金主要投资于短期债券，因此货币市场利率的走高短期内给货币基金带来了不利影响，不过影响在可承受范围之内；中长期看，市场利率的走高将提升货币基金的未来收益水平。本基金报告期内净值收益率为 0.8695%，期间业绩比较基准收益率为 0.9819%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观数据来看，GDP 上半年同比增长 7.1%，与市场预期基本相符；随着进出口的逐步复苏，全年实现 8% 的 GDP 增长问题不大。CPI 和 PPI 由于高基数效应逐渐过去，因此同比数据有望在下半年继续上升。由于上半年的信贷投放过猛，因此下半年的信贷投放速度必将下降，但全年来看，创出历史新高将无悬念。

尽管宏观数据逐步好转，但我们不必过于担心下半年央行的货币政策有所转向。央行将继续维持适度宽松的货币政策，主要还是采取数量型的工具而不是价格型的工具来调控货币市场。货币市场利率在信贷大额投放和新股发行的影响下，继续上行的可能性较大。央行在六月份发行的央票收益率已经有明显的上升，体现了央行对冲流动性的思路。

货币基金下半年的操作思路是，在保障流动性的前提下，控制短融的比例和保持浮息债的占比，并采取短久期配置，尽量规避货币市场利率上行所带来的风险。在货币市场利率调整到位的时候择机购入较高收益的品种，提升货币基金的后期表现。在宏观经济走暖的大环境下，信用债存在利差交易机会，适度挖掘定价有所偏离的信用产品。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合

同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，由投资管理部提交相关投资品种，定量研究部对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行认定，并由双方对确认产生影响的品种根据前述估值模型、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。公司估值委员会对上述过程和结果进行审核，并签署意见，将审核通过的结果交基金结算部处理。基金结算部应将收到的公司估值委员会提供的公允价值数据传至托管银行，托管银行应认真核查基金管理公司采用的估值政策和程序并予以确认。当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司做出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。基金结算部负责联系会计师事务所，会计师事务所应对基金管理公司所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。各方确认无误后，基金结算部使用上述公允价值进行日常的证券投资基金净值计算处理，于托管行核对无误后产生当日估值结果，并对外公布。

在充分考虑参与估值程序各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性的基础上，公司通过建立估值委员会，来最终决定公司旗下各只基金采用何种估值政策和估值程序。估值委员会的主要职责是，对于投资管理部以及定量研究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。估值委员会在签署最终意见前，应当充分参考行业协会的估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会应定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后应及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订建议须经基金管理公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。

本基金管理人参与基金日常估值的人员均有会计专业学习经历，且工作经验丰富。如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，基金经理会参与估值，与定量研究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。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

已签约的会计师事务所对基金管理公司所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。

#### 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 10,029,695.53 元，其中以红利再投方式结转入实收基金金额为 9,764,574.64 元；本报告期末计入应付收益科目金额为 265,120.89 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

中国民生银行根据《天治天得利货币市场基金基金合同》和《天治天得利货币市场基金托管协议》，托管天治天得利货币市场基金（以下简称“天治天得利基金”）。

本报告期，中国民生银行在天治天得利基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，按照国家相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人——天治基金管理有限公司在天治天得利基金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。本报告期，基金管理人——天治基金管理有限公司严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规，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：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款	6.4.6.1	32,026,628.93	840,010,793.48
结算备付金		70,000,000.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.6.2	641,312,356.65	980,693,442.16
其中：股票投资		-	-
债券投资		641,312,356.65	980,693,442.16
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.6.3	41,200,181.80	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.6.4	9,792,168.51	13,908,987.83
应收股利		-	-
应收申购款		1,771,600.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		796,102,935.89	1,834,613,223.47
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2009年6月30日</b>	<b>上年度末 2008年12月31日</b>
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20,773.65	-
应付管理人报酬		276,819.46	362,685.26
应付托管费		83,884.72	109,904.64
应付销售服务费		209,711.70	274,761.52
应付交易费用	6.4.6.5	10,282.80	22,994.45
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		265,120.89	46,428.19
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	69,267.05	54,500.00
负债合计		935,860.27	871,274.06
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.7	795,167,075.62	1,833,741,949.41
未分配利润	6.4.6.8	-	0.00
所有者权益合计		795,167,075.62	1,833,741,949.41
负债和所有者权益总计		796,102,935.89	1,834,613,223.47

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总

额 795,167,075.62 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：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009 年 1 月 1 日- 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日- 2008 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>14,306,060.11</b>	<b>1,179,159.59</b>
1.利息收入		9,174,502.75	1,117,021.35
其中：存款利息收入	6.4.6.9	2,022,409.26	67,084.02
债券利息收入		7,144,821.44	889,036.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,272.05	160,901.25
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,131,557.36	62,138.24
其中：股票投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.10	5,131,557.36	62,138.24
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”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）		-	-
<b>二、费用（以“-”号填列）</b>		<b>-4,276,364.58</b>	<b>-325,093.33</b>
1. 管理人报酬		-1,957,817.24	-100,146.62
2. 托管费		-593,278.00	-30,347.46
3. 销售服务费		-1,483,194.95	-75,868.56
4. 交易费用		-	0.00
5. 利息支出		-166,308.62	-30,173.46
其中：卖出回购金融资产支出		-166,308.62	-30,173.46
6. 其他费用	6.4.6.11	-75,765.77	-88,557.23
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>10,029,695.53</b>	<b>854,066.26</b>
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填</b>		<b>10,029,695.53</b>	<b>854,066.26</b>

列			
---	--	--	--

### 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：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 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）	1,833,741,949.41	-	1,833,741,949.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,029,695.53	10,029,695.53
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）	-1,038,574,873.79	-	-1,038,574,873.79
其中：1. 基金申购款	2,290,931,480.38	-	2,290,931,480.38
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-3,329,506,354.17	-	-3,329,506,354.17
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）	-	-10,029,695.53	-10,029,695.53
五、期末所有者权益（基金净值）	795,167,075.62	-	795,167,075.62
项目	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日 - 2008 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）	56,302,908.69	-	56,302,908.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	854,066.26	854,066.26
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）	54,453,927.88	-	54,453,927.88
其中：1. 基金申购款	248,595,468.20	-	248,595,468.20

2. 基金赎回款 (以“-”号填列)	-194,141,540.32	-	-194,141,540.32
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)	-	-854,066.26	-854,066.26
五、期末所有者权益 (基金净值)	110,756,836.57	-	110,756,836.57

## 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发起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和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、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》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

#### 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 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

**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。**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与 2008 年年度报告相一致。

#### 6.4.5 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》，对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴 20% 的个人所得税。

#### 6.4.6 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	32,026,628.93
定期存款	-
其他存款	-
合计	32,026,628.93

## 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009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	641,312,356.65	643,530,000.00	2,217,643.35	0.2789
	合计	641,312,356.65	643,530,000.00	2,217,643.35	0.2789

注 1：偏离金额=影子定价-摊余成本；

注 2：偏离度=偏离金额/基金资产净值。

## 6.4.6.3 买入返售金融资产

## 6.4.6.3.1 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 2009年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间买入返售	41,200,181.80	-
合计	41,200,181.80	-

## 6.4.6.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应收活期存款利息	6,512.00
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	78,050.00
应收债券利息	9,699,933.88
应收买入返售证券利息	7,272.05
应收申购款利息	400.58
其他	-
合计	9,792,168.51

## 6.4.6.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2009 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	10,282.80
合计	10,282.80

## 6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	300.28
预提审计费	24,795.19
预提帐户维护费	4,500.00
预提上证报信息披露费	39,671.58
合计	69,267.05

## 6.4.6.7 实收基金

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	帐面金额
上年度末	1,833,741,949.41	1,833,741,949.41
本期申购	2,290,931,480.38	2,290,931,480.38
本期赎回	-3,329,506,354.17	-3,329,506,354.17
本期末	795,167,075.62	795,167,075.62

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.6.8 未分配利润

金额单位：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	10,029,695.53	-	10,029,695.53
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	-10,029,695.53	-	-10,029,695.53
本期末	-	-	-

## 6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	903,242.09

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	1,109,004.05
其他	10,163.12
合计	2,022,409.26

#### 6.4.6.10 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额	1,478,708,554.12
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-1,444,705,885.78
应收利息总额	-28,871,110.98
债券投资收益	5,131,557.36

#### 6.4.6.11 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
开户费	-
账户维护费用	9,000.00
银行汇划费用	2,299.00
其他	-
合计	75,765.77

#### 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.7.1 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。

##### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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、基金发起人、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
吉林省信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
中国吉林森林工业集团有限责任公司	基金管理人的股东
吉林市国有资产经营有限责任公司	基金管理人的股东

#### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金 2009 年上半年度及 2008 年上半年度均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.9.2 关联方报酬

###### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日
当期应支付的管理费	1,957,817.24	100,146.62
其中：当期已支付	1,680,997.78	78,420.85
期末未支付	276,819.46	21,725.77

注：(1) 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 为每日应支付的基金管理费

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。

(2) 上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上期应付管理费。

###### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日
当期应支付的托管费	593,278.00	30,347.46
其中：当期已支付	509,393.28	23,763.89
期末未支付	83,884.72	6,583.57

注：(1) 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 为每日应支付的基金托管费

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。

(2) 上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上期应付托管费。

#### 6.4.9.2.3 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 2009年1月1日 - 2009年6月30日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
天治基金管理有限公司	1,273,483.25	209,711.70	1,483,194.95
合计	1,273,483.25	209,711.70	1,483,194.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
天治基金管理有限公司	59,409.67	16,458.89	75,868.56
合计	59,409.67	16,458.89	75,868.56

注：(1) 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。在通常情况下，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 为每日应支付的基金销售服务费

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。

(2) 上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上期应付销售费用。

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在 2009 上半年度及 2008 年上半年度未通过银行间同业市场与关联方进行债券（含回购）交易。

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人 2009 年上半年度及 2008 年上半年度均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.9.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于 2009 年上半年度和 2008 年上半年度均未投资本基金。

#### 6.4.9.5 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 2009年1月1日 - 2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008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
民生银行	32,026,628.93	903,242.09	2,079,649.31	61,107.50

**6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金在 2009 年上半年度及 2008 年上半年度均不存在在承销期内直接购入关联方所承销证券的情况。

**6.4.10 利润分配情况**

单位：人民币元

项目	本期累计分配金额
再投资形式发放	10,029,695.53

注：本期累计分配金额里包括 09 年应付利润余额为 265,120.89 元。

**6.4.11 期末（2009 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有流通受限证券。

**6.4.12 金融工具风险及管理****6.4.12.1 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。

**6.4.12.2 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。

**6.4.12.3 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。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。

#### 6.4.12.4 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。

##### 6.4.12.4.1 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。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。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。

单位：人民币元

本期末 2009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	32,026,628.93	-	-	-	-	-	32,026,628.93
结算备付金	70,000,000.00	-	-	-	-	-	70,000,000.00
交易性金融资产	100,091,758.73	170,786,321.43	370,434,276.49	-	-	-	641,312,356.65
买入返售金融资产	41,200,181.80	-	-	-	-	-	41,200,181.80
应收利息	-	-	-	-	-	9,792,168.51	9,792,168.51
应收申购款	1,771,600.00	-	-	-	-	-	1,771,600.00
资产总计	245,090,169.46	170,786,321.43	370,434,276.49	-	-	9,792,168.51	796,102,935.89
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,773.65	20,773.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	276,819.46	276,819.46
应付托管费	-	-	-	-	-	83,884.72	83,884.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-	209,711.70	209,711.70
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,282.80	10,282.80
应付利润	-	-	-	-	-	265,120.89	265,120.89
其他负债	-	-	-	-	-	69,267.05	69,267.05
负债总计	-	-	-	-	-	935,860.27	935,860.27
利率敏感度缺口	245,090,169.46	170,786,321.43	370,434,276.49	-	-	8,856,308.24	795,167,075.62
上年度末 2008 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	840,010,793.48	-	-	-	-	-	840,010,793.48
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	210,071,077.39	420,392,634.52	350,229,730.25	-	-	-	980,693,442.16
应收利息	-	-	-	-	-	13,908,987.83	13,908,987.83
资产总计	1,050,081,870.87	420,392,634.52	350,229,730.25	-	-	13,908,987.83	1,834,613,223.47
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	362,685.26	362,685.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	109,904.64	109,904.64
应付托管费	-	-	-	-	-	274,761.52	274,761.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	22,994.45	22,994.45
应交税费	-	-	-	-	-	46,428.19	46,428.19
其他负债	-	-	-	-	-	54,500.00	54,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	871,274.06	871,274.06
利率敏感度缺口	1,050,081,870.87	420,392,634.52	350,229,730.25	-	-	13,037,713.77	1,833,741,949.41

#### 6.4.12.4.1.2 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。

#### 6.4.12.4.2 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。

#### 6.4.12.4.3 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，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 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	641,312,356.65	80.56
	其中：债券	641,312,356.65	80.56
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	41,200,181.80	5.18
	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	102,026,628.93	12.82
4	其他资产	11,563,768.51	1.45
5	合计	796,102,935.89	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	6,317,982,923.00	3.20
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，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日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

## 7.3 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%。

## 7.4 基金投资组合平均剩余期限

### 7.4.1 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	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	143
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：报告期内投资组合平均剩余期限没有超过 180 天的情况。

### 7.4.2 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	30.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	1.24	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.24	-
3	60 天(含)—90 天	20.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	7.58	-
4	90 天(含)—180 天	13.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	32.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	10.02	-
6	合计	98.66	-

#### 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	109,711,443.07	13.80
3	金融债券	249,927,394.05	31.43
-	其中：政策性金融债	150,020,799.55	18.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	281,673,519.53	35.42
6	其他	-	-
7	合计	641,312,356.65	80.65
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	149,835,635.32	18.84

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	040211	04 国开 11	1,000,000	100,091,758.73	12.59
2	0801114	08 央票 114	1,000,000	99,601,774.49	12.53
3	040705	04 建行 03 浮	800,000	79,701,941.07	10.02
4	0881188	08 中普天 CP01	500,000	50,506,402.27	6.35
5	0881183	08 农六师 CP01	500,000	50,146,224.91	6.31
6	0981074	09 华联 CP01	500,000	50,020,973.10	6.29
7	0981022	09 集通 CP01	400,000	40,442,835.62	5.09
8	080303	08 进出 03	400,000	40,041,273.51	5.04
9	0981002	09 甘电投 CP01	300,000	30,345,300.89	3.82
10	0981053	09 苏国信 CP01	300,000	30,020,735.94	3.78

### 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	107
报告期内偏离度的最高值	0.3482%
报告期内偏离度的最低值	0.2030%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2819%

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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，2007 年 7 月 1 日前按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益；2007 年 7 月 1 日起，按实际利率并考虑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** 本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

**7.9.3** 本基金投资的前十名证券的发行主体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。

#### 7.9.4 其他资产构成

金额单位：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	9,792,168.51

4	应收申购款	1,771,600.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	11,563,768.51

#### 7.9.5 其他需说明的重要事项

本基金报告期内无需要说明的其他重要事项。

## 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
1,902	418,068.91	583,085,683.65	73.33%	212,081,391.97	26.67%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	0.00	0%

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	1,095,807,464.98
报告期期初基金份额总额	1,833,741,949.41
报告期期间基金总申购份额	2,290,931,480.38
报告期期间基金总赎回份额	-3,329,506,354.17
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	795,167,075.62

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本半年度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 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来，未变更过会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		应支付该券商的佣金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
东北证券	-	-	-	-	-	-

注 1：基金专用席位的选择标准和程序：

- (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，确定证券的席位作为本基金专用交易席位，并签订席位租用协议。

注 2：本基金本报告期内无租用券商交易单元变动情况。

## 10.8 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	天治天得利货币市场基金“春节”假期前暂停申购及转入业务的公告	指定媒体及公司网站	2009 年 1 月 19 日
2	天治天得利货币市场基金 2008 年第 4 季度报告	指定媒体及公司网站	2009 年 1 月 21 日
3	天治基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或身份证明文件的通知	指定媒体及公司网站	2009 年 2 月 6 日
4	天治天得利货币市场基金更新的招募说明书（摘要）（2009 年 2 月）	指定媒体及公司网站	2009 年 2 月 19 日
5	天治基金管理有限公司关于在部分代销机构开通旗下基金定投业务及部分基金之间基金转换业务的公告	指定媒体及公司网站	2009 年 3 月 25 日
6	天治天得利货币市场基金 2008 年年度报告摘要	指定媒体及公司网站	2009 年 3 月 27 日
7	天治天得利货币市场基金 2009 年第 1 季度报告	指定媒体及公司网站	2009 年 4 月 22 日
8	天治基金管理有限公司关于在部分代销机构开通旗下基金定投业务及部分基金之间基金转换业务的公告	指定媒体及公司网站	2009 年 4 月 27 日
9	天治基金管理有限公司关于增加爱建证券为代销机构的公告	指定媒体及公司网站	2009 年 5 月 5 日
10	天治基金管理有限公司关于增加联合证券为天治天得利货币市场基金代销机构的公告	指定媒体及公司网站	2009 年 5 月 19 日

11	天治天得利货币市场基金“端午节”假期前暂停申购及转入业务的公告	指定媒体及公司网站	2009 年 5 月 22 日
12	天治基金管理有限公司关于增加东海证券为代销机构的公告	指定媒体及公司网站	2009 年 5 月 25 日
13	天治基金管理有限公司关于在宏源证券开通旗下部分基金之间基金转换业务的公告	指定媒体及公司网站	2009 年 6 月 19 日
14	天治基金管理有限公司关于增加新时代证券为代销机构的公告	指定媒体及公司网站	2009 年 6 月 29 日

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证监会批准天治天得利货币市场基金设立的文件
- 11.1.2 《天治天得利货币市场基金基金合同》
- 11.1.3 《天治天得利货币市场基金招募说明书》
- 11.1.4 《天治天得利货币市场基金托管协议》
- 11.1.5 报告期内天治天得利货币市场基金公告的各项原稿

### 11.2 存放地点

存放地点：上海市复兴西路 159 号

### 11.3 查阅方式

11.3.1 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。

11.3.2 网站查询：[www.chinanature.com.cn](http://www.chinanature.com.cn)

天治基金管理有限公司  
二〇〇九年八月二十五日