

天治天得利货币市场基金

2016年年度报告摘要

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

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日核对了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务计划报告、投资组合报告等内容，保证复核后不存在虚假记载、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2016年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天治天得利货币
基金简称(TCH)	560004
交易代码	560004
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
报告期基金单位净值	0.9980(0.9984)
基金份额的限制	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以银行存款工具为投资对象，根据宏观经济、货币政策和资金面的变化，通过分析利率、汇率、债券、股票、商品等金融资产的预期收益与风险，合理配置资产，力争在严格控制风险的前提下，实现资产的稳定增值。
投资策略	本基金以银行存款工具为投资对象，根据宏观经济、货币政策和资金面的变化，通过分析利率、汇率、债券、股票、商品等金融资产的预期收益与风险，合理配置资产，力争在严格控制风险的前提下，实现资产的稳定增值。
业绩比较基准	银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	货币市场的低风险投资品种，长期风险和预期收益率较低，适合风险偏好较低的投资者。
基金管理人和基金托管人	天治基金管理有限公司 中国民生银行股份有限公司

2.3 基金管理人和基金托管人	基金管理人 名称 住所 法定代表人 联系人 客户服务电话 传真	基金管理人 名称 住所 法定代表人 联系人 客户服务电话 传真
	天治基金管理有限公司 中国民生银行股份有限公司 罗国华 王海峰 021-60371198 010-58889006 shaoxian@huanzitong.com 000-000-2000 000-000-2000 000-000-2000	天治基金管理有限公司 中国民生银行股份有限公司 罗国华 王海峰 021-60371198 010-58889006 shaoxian@huanzitong.com 000-000-2000 000-000-2000 000-000-2000

2.4 信息披露

登载基金年度报告的管理人互联网网址
www.chinatreat.com

基金份额年度报告的存放地点
基金管理人和基金托管人的办公场所

§ 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 本期基金合同期间	2016年	2016年	2014年	
1.本期实现收益	22,043,960.00	22,000,962.71	40,299,763.29	
2.本期已实现收益	22,043,960.00	22,000,962.71	40,299,763.29	
3.本期可供分配收益	22,034% 3,411%	4,060% 3,438%	4,060% 3,438%	
4.期末可供分配利润	2016年末 2015年末	2016年末 2015年末	2016年末 2015年末	
5.期末基金净值	550,020,226.44 400,392,715.64	400,392,715.64 294,067,074.34	400,392,715.64 294,067,074.34	
6.期末基金份额净值	1.0000 1.0000	1.0000 1.0000	1.0000 1.0000	

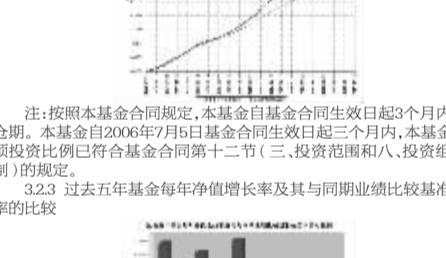
注：基金利润分配是按日结转份额。

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	份额净收益 增长百分比 (%)	同期业绩比较 基准收益率 (%)	收益类型		①-③ (%)	②-④ (%)
			收入型	资本利得型		
过去三个月	0.0220% 0.0314%	0.0277% 0.0304%	0.0000%	0.0000%	0.0143% 0.0114%	0.0010% 0.0014%
过去一年	0.2244% 0.3342%	0.2200% 0.3200%	0.0600% <td>0.0600%</td> <td>0.0143% 0.0114%</td> <td>0.0010% 0.0014%</td>	0.0600%	0.0143% 0.0114%	0.0010% 0.0014%
过去三年	10.3111% 0.0602%	6.0000% 0.0600%	0.0010% <td>0.0010%</td> <td>4.3108% 0.0044%</td> <td>0.7797% 0.0043%</td>	0.0010%	4.3108% 0.0044%	0.7797% 0.0043%
自基金合同生效以来	100.00%	0.0000%	11,857,079.00	0.0000%	100.00%	0.0000%

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



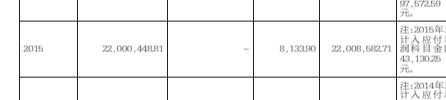
注：按照本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。本基金自2006年7月5日基金合同生效之日起3个月内，本基金的各项投资比例已符合基金合同第十二节“三、投资范围和八、投资组合限制”的规定。

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



注：按照本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。本基金自2006年7月5日基金合同生效之日起3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。

3.2.4 过去五年基金每年净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较



注：按照本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。本基金自2006年7月5日基金合同生效之日起3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。

3.2.5 过去三年基金的利润分配情况

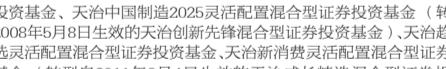
单位：人民币元

单位：人民币元				
3.3 本期利润分配情况	2016年	2016年	2014年	
1.本期利润	22,043,960.00	22,000,962.71	40,299,763.29	
2.本期已实现收益	22,043,960.00	22,000,962.71	40,299,763.29	
3.本期可供分配收益	22,034% 3,411%	4,060% 3,438%	4,060% 3,438%	
4.期末可供分配利润	2016年末 2015年末	2016年末 2015年末	2016年末 2015年末	
5.期末基金净值	550,020,226.44 400,392,715.64	400,392,715.64 294,067,074.34	400,392,715.64 294,067,074.34	
6.期末基金份额净值	1.0000 1.0000	1.0000 1.0000	1.0000 1.0000	

注：基金利润分配是按日结转份额。

3.2.6 基金净值表现

3.2.7 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率增长率的比较



注：按照本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。本基金自2006年7月5日基金合同生效之日起3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。

3.2.8 基金利润分配情况

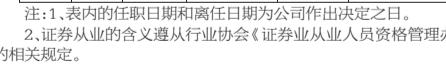
单位：人民币元

单位：人民币元				
3.3 本期利润分配情况	2016年	2016年	2014年	
1.本期利润	22,043,960.00	22,000,962.71	40,299,763.29	
2.本期已实现收益	22,043,960.00	22,000,962.71	40,299,763.29	
3.本期可供分配收益	22,034% 3,411%	4,060% 3,438%	4,060% 3,438%	
4.期末可供分配利润	2016年末 2015年末	2016年末 2015年末	2016年末 2015年末	
5.期末基金净值	550,020,226.44 400,392,715.64	400,392,715.64 294,067,074.34	400,392,715.64 294,067,074.34	
6.期末基金份额净值	1.0000 1.0000	1.0000 1.0000	1.0000 1.0000	

注：基金利润分配是按日结转份额。

3.2.9 基金净值表现

3.2.10 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率增长率的比较



注：按照本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。本基金自2006年7月5日基金合同生效之日起3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。

3.2.11 基金利润分配情况

单位：人民币元

单位：人民币元				

<tbl_r cells="5" ix="2