

# 天治天得利货币市场基金

## 2024 年年度报告

2024 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:2025 年 03 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2025年3月21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2024年1月1日起至12月31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.....	6
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、基金净值表现及利润分配情况 .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告 .....	13
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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 .....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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 .....	19
§5 托管人报告 .....	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	19
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 .....	19
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 .....	19
§6 审计报告 .....	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容 .....	20
§7 年度财务报表.....	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表 .....	24
7.3 净资产变动表 .....	26
7.4 报表附注 .....	28
§8 投资组合报告 .....	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 债券回购融资情况.....	55
8.3 基金投资组合平均剩余期限 .....	55
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 .....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	56
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 .....	57
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....	57
8.8 期末按公允价值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.....	58
8.9 投资组合报告附注.....	58
§9 基金份额持有人信息.....	59

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
9.4 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 .....	60
§10 开放式基金份额变动 .....	61
§11 重大事件揭示 .....	61
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	64
11.9 其他重大事件 .....	64
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
12.1 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 .....	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
§13 备查文件目录 .....	68
13.1 备查文件目录 .....	68
13.2 存放地点 .....	69
13.3 查阅方式 .....	69

## §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	969,635,532.05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	天治天得利货币C
下属分级基金的交易代码	350004	008742	022125
报告期末下属分级基金的份额总额	126,114,531.53份	843,521,000.52份	0.00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	姚静静	林盛
	联系电话	021-60371155	010-58560666
	电子邮箱	yaojj@chinanature.com.cn	tgxxpl@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	010-57093382
注册地址		上海市徐汇区丰谷路315弄24号1-3层	北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址		上海市云锦路701号西岸智塔东塔19楼	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码		200232	100031
法定代表人		马铁刚	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）	上海市浦东新区世纪大道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	上海市云锦路701号西岸智塔东塔19楼

## §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	2024年			2023年			2022年		
	天治天得利货币A	天治天得利货币B	天治天得利货币C	天治天得利货币A	天治天得利货币B	天治天得利货币C	天治天得利货币A	天治天得利货币B	天治天得利货币C
本期已实现收益	2,608,871.82	9,327,029.50	11,231.13	2,034,699.75	6,823,605.58	-	906,036.67	3,231,440.32	-
本期利润	2,608,871.82	9,327,029.50	11,231.13	2,034,699.75	6,823,605.58	-	906,036.67	3,231,440.32	-
本期净值收益率	1.6280%	1.7797%	0.1912%	1.9013%	2.0536%	-	1.4910%	1.6433%	-
3.1.2 期末数据和指标	2024年末			2023年末			2022年末		
期末基金资产净值	126,145,315.3	843,521,000.52	-	197,506,686.60	2,682,634,273.63	-	76,532,007.42	492,379,638.13	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	-	1.0000	1.0000	-
3.1.3 累计期末指标	2024年末			2023年末			2022年末		
累计净值收益率	64.9511%	10.1002%	0.1912%	62.3087%	8.1751%	-	59.2804%	5.9983%	-

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金无持有人申购、赎回的交易费用。

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

- 3、本基金收益分配是按日结转份额。  
4、本基金自2024年9月10日起新增C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
过去三个月	0.3474%	0.0019%	0.3277%	0.0000%	0.0197%	0.0019%
过去六个月	0.6811%	0.0017%	0.6553%	0.0000%	0.0258%	0.0017%
过去一年	1.6280%	0.0042%	1.3036%	0.0000%	0.3244%	0.0042%
过去三年	5.1043%	0.0041%	3.9036%	0.0000%	1.2007%	0.0041%
过去五年	9.2270%	0.0039%	6.5071%	0.0000%	2.7199%	0.0039%
自基金合同生效起至今	64.9511%	0.0059%	36.0761%	0.0021%	28.8750%	0.0038%

##### 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
过去三个月	0.3852%	0.0019%	0.3277%	0.0000%	0.0575%	0.0019%
过去六个月	0.7570%	0.0017%	0.6553%	0.0000%	0.1017%	0.0017%
过去一年	1.7797%	0.0042%	1.3036%	0.0000%	0.4761%	0.0042%
过去三年	5.5768%	0.0041%	3.9036%	0.0000%	1.6732%	0.0041%
过去五年	10.0465%	0.0039%	6.5071%	0.0000%	3.5394%	0.0039%
自基金合同生效起至今	10.1002%	0.0039%	6.5321%	0.0000%	3.5681%	0.0039%

##### 天治天得利货币C

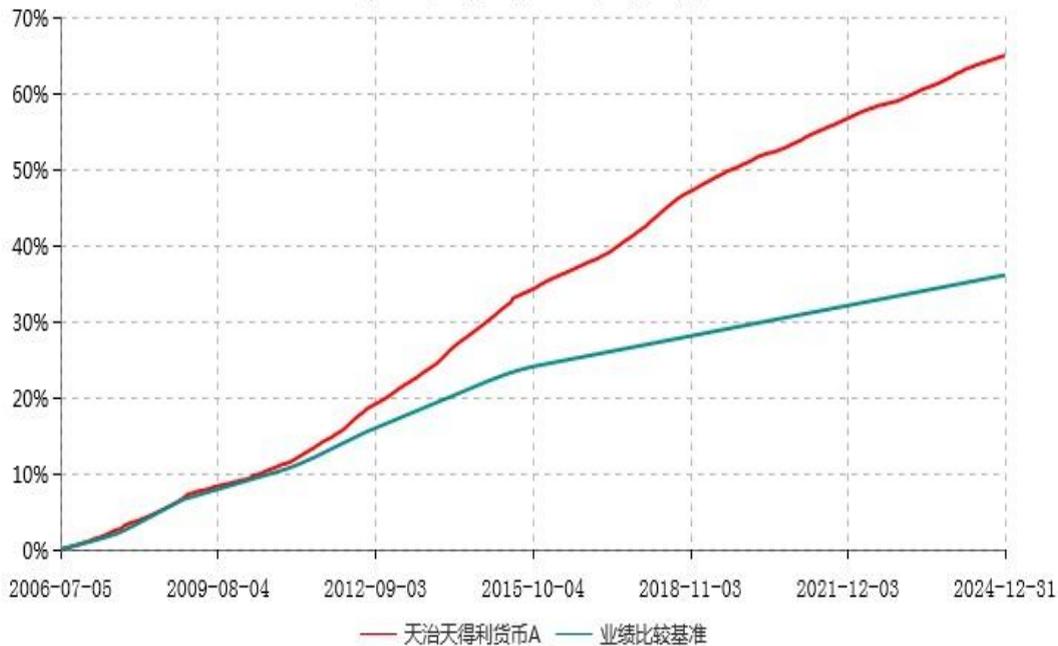
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差④		
过去三个月	0.1088%	0.0020%	0.0890%	0.0000%	0.0198%	0.0020%
自基金合同生效起至今	0.1912%	0.0023%	0.1567%	0.0000%	0.0345%	0.0023%

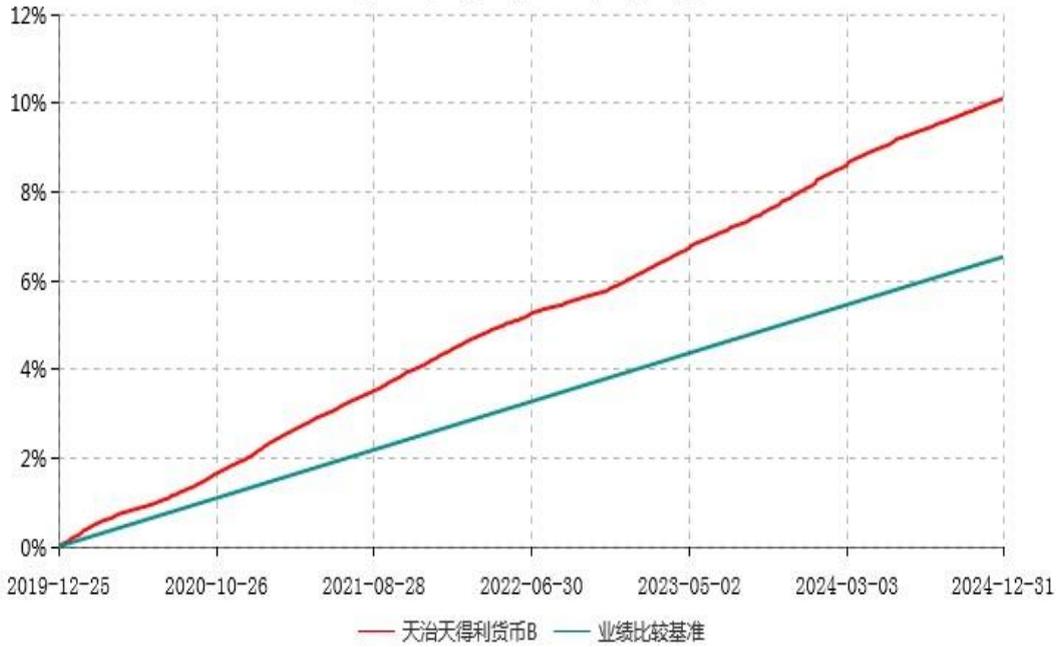
注：本基金自2024年9月10日起新增C类基金份额。2024年10月10日至2024年12月1日、2024年12月18日至2024年12月31日该类基金份额为零，对应区间净值收益率及业绩比较基准不做统计。

### 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-2024年12月31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-2024年12月31日)



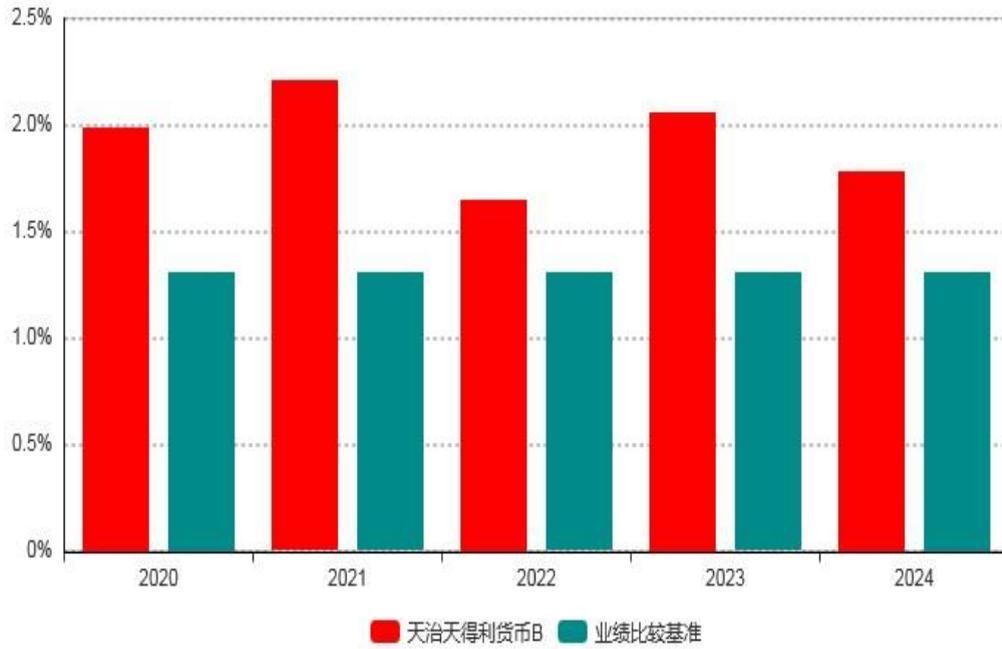
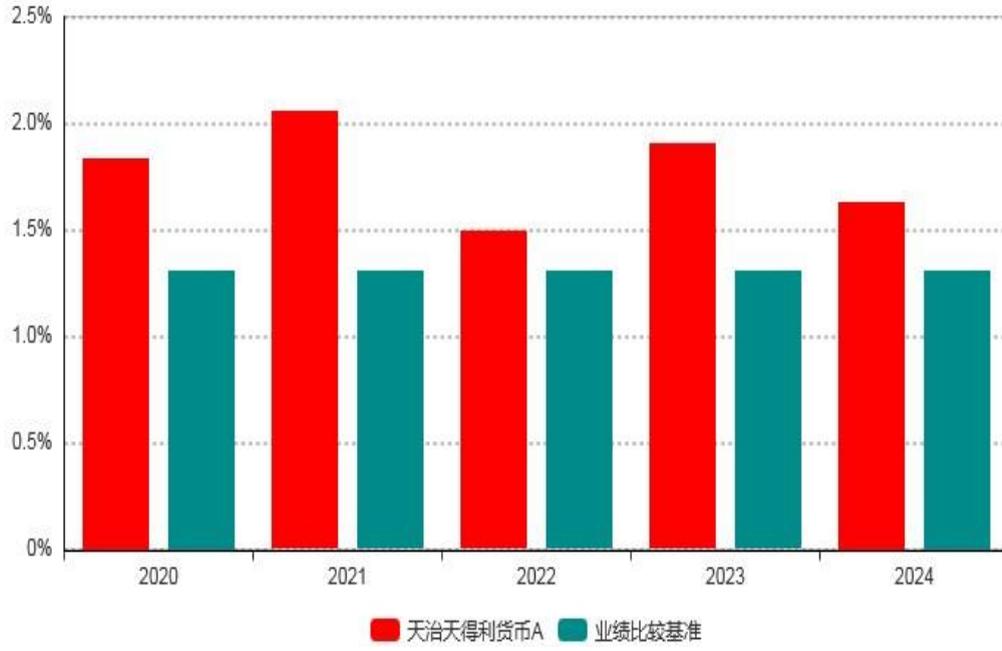
注：本基金自2019年12月25日起新增B类基金份额。

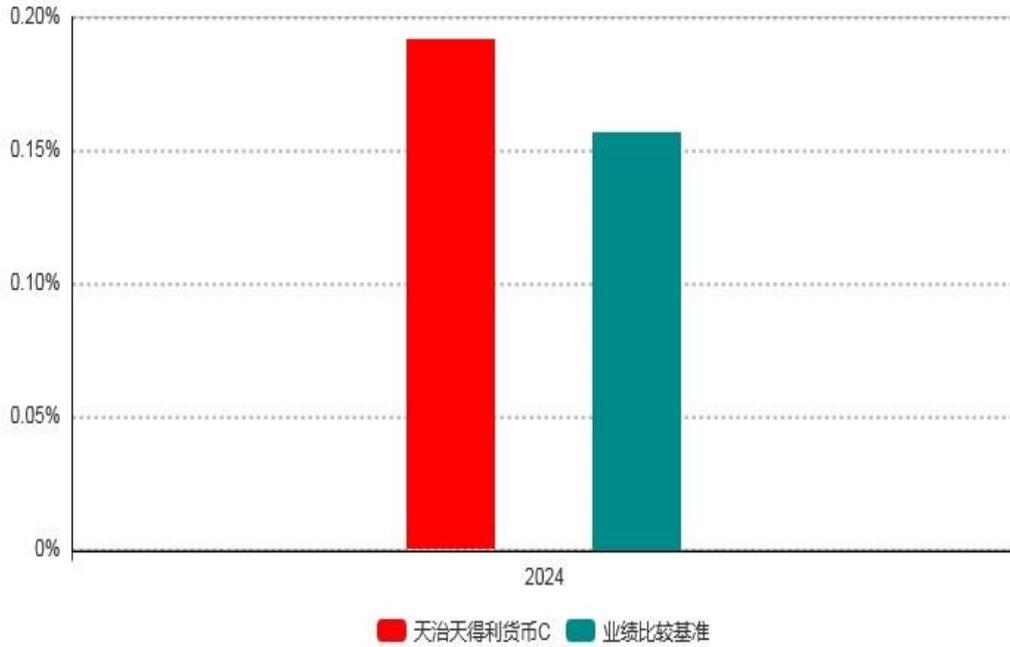
天治天得利货币C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2024年09月12日-2024年12月31日)



注：本基金自2024年9月10日起新增C类基金份额。2024年10月10日至2024年12月1日、2024年12月18日至2024年12月31日该类基金份额为零，对应区间累计净值收益率及业绩比较基准不变。

### 3.2.3 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比较





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

天治天得利货币A

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
2024年	2,643,640.78	-	-34,768.96	2,608,871.82	注：2024年末计入应付利润科目金额4,982.86元
2023年	2,007,693.40	-	27,006.35	2,034,699.75	注：2023年末计入应付利润科目金额39,751.82元
2022年	898,427.08	-	7,609.59	906,036.67	注：2022年末计入应付利润科目金额12,745.47元
合计	5,549,761.26	-	-153.02	5,549,608.24	-

天治天得利货币B

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
2024年	9,862,76 1.02	-	-535,73 1.52	9,327,02 9.50	注：2024年末计入应付利润科目金额36,935.10元
2023年	6,337,10 2.93	-	486,502. 65	6,823,60 5.58	注：2023年末计入应付利润科目金额572,666.62元
2022年	3,157,22 9.24	-	74,211.0 8	3,231,44 0.32	注：2022年末计入应付利润科目金额86,163.97元
合计	19,357,09 3.19	-	24,982.2 1	19,382,07 5.40	-

天治天得利货币C

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
2024年	11,231.13	-	-	11,231.13	-
合计	11,231.13	-	-	11,231.13	-

## §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2024年12月31日，本基金管理人旗下共有十五只开放式基金，除本基金外，另外十四只基金--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

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、天治天享66个月定期开放债券型证券投资基金、天治鑫祥利率债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、2021年9月16日、2023年7月10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	固定收益部副总监、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、天治天享66个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、天治鑫祥利率债债券型证券投资基金基金经理	2019-09-04	-	13年	硕士研究生,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、天治基金管理有限公司固定收益部总监助理
黄月镞	本基金基金经理	2023-08-15	-	9年	硕士研究生,具有基金从业资格。曾任国联安基金管理有限公司交易员、淳厚基金管理有限公司债券交易员、东亚前海证券有限责任公司资产管理部债券交易员、兴银基金管理有限责任公司债券交易员。

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

本报告期内，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、勤勉尽责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。本报告期内，基金运作合法合规，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同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，则不能说明不公平交易；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，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

2024年我国实际GDP增速为5.0%，较2023年小幅放缓。国内经济总量表现稳中有进，但结构分化明显。从需求角度看，外需对经济增长的拉动贡献较大，货物和服务净出口对经济增速的拉动约为1.5%，较23年抬升1.2个百分点；而以消费和投资为代表的内需对经济增速的拉动约为3.5%，较23年回落2.5个百分点，其中消费需求不足的矛盾凸显。物价水平方面，CPI同比上涨0.2%，涨幅与23年相同，扣除食品和能源价格的核心CPI继续保持温和上涨；PPI同比下降2.2%，降幅比23年收窄0.8个百分点，受益于新质生产力稳步发展，产业转型升级对工业品价格起到拉升作用。货币政策方面，央行全年两次降准

共1个百分点，并综合运用公开市场操作、开展国债买卖、中期借贷便利等多种工具，保持流动性合理充裕。同时央行不断健全货币政策框架，推动社会综合融资成本稳中有降，全年两次调降政策利率共30bp，引导1年期及5年期以上LPR分别累计下调35bp和60bp。

债券市场方面，在融资需求放缓、市场风险偏好低迷以及政策利率大幅调降的背景下，全年债市走势以震荡下行为主，其中二季度因央行提示长债风险，四季度因稳增长政策密集落地引发债市短暂回调。截至2024年12月31日，10年期国债收益率收至1.675%，较23年年末下行88bp，1年期AAA同业存单收益率收至1.575%，较23年年末下行82.5bp。流动性方面，银行间资金面保持平稳均衡，流动性分层现象不明显，R007均值为1.96%，较23年下降27bp。

报告期内，本基金在保证流动性需求的情况下，综合考虑宏观经济走势及流动性充裕情况，判断资金及短期资产的利率走势，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1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.6280%，同期业绩比较基准收益率为1.3036%；截至报告期末天治天得利货币B基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.7797%，同期业绩比较基准收益率为1.3036%。本基金自2024年9月10日起新增C类基金份额。2024年10月10日至2024年12月1日、2024年12月18日至2024年12月31日该类基金份额为零，对应区间净值收益率及业绩比较基准不做统计。截至报告期末天治天得利货币C基金份额净值为1.0000元，自基金合同生效起至本报告期末，该类基金份额净值收益率为0.1912%，同期业绩比较基准收益率为0.1567%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从地方两会公布的经济增长目标来看，预计2025年全国经济增长目标有望保持在5%左右。2024年12月召开的政治局会议和中央经济工作会议中已明确2025年各项政策基调和发力重点，2025年将实施更加积极的财政政策、适度宽松的货币政策，通过扩大国内需求、推动科技创新和产业创新融合发展等方面来推动经济持续回升向好。其中，化债政策持续推进将为地方政府和企业减负担、增动能，信贷数据有望出现修复；通过稳定楼市、提振股市，居民收入预期和市场信心将稳步回升；“两新”政策加力扩围，内需潜力将有效激发。物价方面，新一轮供给侧改革有望带动产能周期触底，实现工业品价格回暖，将对整体物价水平回升起到关键作用。

债券市场方面，2025年经济基本面处于回升验证阶段，债市收益率或保持低位运行。预计在经济增长回升向好、社会融资成本稳中有降的趋势下，收益率曲线或呈陡峭化。

开年以来市场对货币宽松预期抢跑，长端已大幅定价降息幅度，后续可关注货币宽松落地节奏和风险偏好提升对长端走势带来的扰动。政府债券发行前置、稳汇率和防止资金空转等因素或造成银行间资金面短期收敛，但在支持性的货币政策基调下，预计银行间流动性将保持合理均衡。

基于以上展望，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，借助积极的投资操作和灵活的组合调整，把握交易窗口期，择优增加高收益资产配置，为投资者获取稳定的收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024年，本基金管理人持续依照法律法规规定和公司内控制度要求独立开展监察稽核工作，通过现场检查、系统实时监控、人员询问、重点抽查等方式，监督本基金运作相关的内控制度建设及各项制度执行情况，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、基金结算及人事管理等业务环节。

本基金管理人内部监察稽核发现：

一、报告期内，本基金管理人持续更新、完善了内部控制体系，制定或修订了多项内部控制制度，有效保障了公司相关机构职能的发挥及业务的发展，本基金管理人的内部控制体系覆盖了本基金运作的所有环节。

二、报告期内，监察稽核过程中未发现本基金运作过程存在重大违反法律法规、内部控制制度的情况，各项相关制度均能有效执行，本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旗下基金运作的检查监督，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分管基金运营的分管领导、投资总监、研究发展部总监、权益投资部总监、固定收益部总监、基金结算部总监、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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规及《天治天得利货币市场基金合同》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）。详见7.4.11利润分配情况。

#### **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**

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### **§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》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，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，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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，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约定进行。

#### **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**

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（2025）审字第70015648_B09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
审计意见	我们审计了天治天得利货币市场基金的财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表，2024年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的天治天得利货币市场基金的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2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于天治天得利货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	天治天得利货币市场基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对

	<p>财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估天治天得利货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督天治天得利货币市场基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计</p>

	<p>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。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对天治天得利货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天治天得利货币市场基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
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）	
注册会计师的姓名	石静筠	骆文慧
会计师事务所的地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼	
审计报告日期	2025-03-21	

## §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：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
资产：			

货币资金	7.4.7.1	32,700,550.04	397,928.75
结算备付金		-	9,244.01
存出保证金		1,115.28	1,149.64
交易性金融资产	7.4.7.2	599,019,509.72	1,753,228,484.31
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		599,019,509.72	1,753,228,484.31
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	308,067,564.58	1,096,436,507.70
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		30,276,516.00	31,113,394.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		970,065,255.62	2,881,186,709.18
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年12月31日</b>	<b>上年度末 2023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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		99,734.61	123,204.51
应付托管费		24,933.66	30,801.13
应付销售服务费		65,793.93	81,471.03

应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,170.95	6,118.53
应付利润		41,917.96	612,418.44
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	192,172.46	191,735.31
负债合计		429,723.57	1,045,748.95
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	969,635,532.05	2,880,140,960.23
未分配利润	7.4.7.8	-	-
净资产合计		969,635,532.05	2,880,140,960.23
负债和净资产总计		970,065,255.62	2,881,186,709.18

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额969,635,532.05份。其中A类基金份额净值1.0000元，份额总额126,114,531.53份；B类基金份额净值1.0000元，份额总额843,521,000.52份；C类基金份额净值1.0000元，份额总额0.00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：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2 023年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		15,211,087.99	10,891,319.77
1.利息收入		4,371,522.34	3,720,283.83
其中：存款利息收入	7.4.7.9	117,153.13	14,351.95
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,254,369.21	3,705,931.88
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填		10,839,565.65	7,171,035.94

列)			
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	10,839,565.65	7,171,035.94
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.17	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		3,263,955.54	2,033,014.44
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,459,856.18	874,140.72
2.托管费	7.4.10.2.2	364,964.03	218,535.21
3.销售服务费	7.4.10.2.3	971,700.85	600,541.74
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		240,037.76	112,381.58
其中：卖出回购金融资产支 出		240,037.76	112,381.58
6.信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		7,997.13	4,256.27
8.其他费用	7.4.7.19	219,399.59	223,158.92
<b>三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）</b>		11,947,132.45	8,858,305.33
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”</b>		11,947,132.45	8,858,305.33

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		11,947,132.45	8,858,305.33

### 7.3 净资产变动表

会计主体：天治天得利货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,880,140,960.23	-	2,880,140,960.23
二、本期期初净资产	2,880,140,960.23	-	2,880,140,960.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,910,505,428.18	-	-1,910,505,428.18
（一）、综合收益总额	-	11,947,132.45	11,947,132.45
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,910,505,428.18	-	-1,910,505,428.18
其中：1.基金申购款	7,522,710,565.34	-	7,522,710,565.34
2.基金赎回款	-9,433,215,993.52	-	-9,433,215,993.52
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少	-	-11,947,132.45	-11,947,132.45

以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	969,635,532.05	-	969,635,532.05
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	568,911,645.55	-	568,911,645.55
二、本期期初净资产	568,911,645.55	-	568,911,645.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,311,229,314.68	-	2,311,229,314.68
（一）、综合收益总额	-	8,858,305.33	8,858,305.33
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,311,229,314.68	-	2,311,229,314.68
其中：1.基金申购款	4,601,783,480.30	-	4,601,783,480.30
2.基金赎回款	-2,290,554,165.62	-	-2,290,554,165.62
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-8,858,305.33	-8,858,305.33
四、本期期末净资产	2,880,140,960.23	-	2,880,140,960.23

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：

许家涵

许家涵

孙丽平

-----  
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。根据基金管理人于2024年9月7日发布的《天治基金管理有限公司关于天治天得利货币市场基金增加C类基金份额并修订基金合同等法律文件的公告》，自2024年9月10日起，本基金增加C类基金份额。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。本基金设A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额，三类基金份额单独设置对应的基金代码，并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

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）。

### 7.4.2 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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自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

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，在初始确认时以公允价值计量；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利

率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 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。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值，即按实际利率法计算金融资产的账面价值，同时为了避免按实际利率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”。当按实际利率法计算确定的基金资产净值与影子定价确定的基金资产净值产生重大偏离，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。

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方法估值；

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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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 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账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，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，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) 债券投资和资产支持证券投资按实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，在债券投资和资产支持证券投资的实际持有期内逐日计提；处置债券投资和资产支持证券投资的收益于成交日确认，并按成交金额与其账面价值的差额入账；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别内的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介上公告；

(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。

#### 7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

#### 7.4.6.1 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征增值税试点的通知》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，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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资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。对证券投资基金在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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### 7.4.6.2 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法》、《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、营业税的单位和个体，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发展费附加的单位外）及地方教育附加。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	2,658,427.84	397,928.75
等于：本金	2,658,229.69	397,651.74

加：应计利息	198.15	277.01
减：坏账准备	-	-
定期存款	30,042,122.20	-
等于：本金	30,000,000.00	-
加：应计利息	42,122.20	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	20,004,722.20	-
存款期限3个月以上	10,037,400.00	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	32,700,550.04	397,928.75

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年12月31日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	8,095,006.89	8,101,071.78	6,064.89	0.0006
	银行间市场	590,924,502.83	591,230,624.17	306,121.34	0.0316
	合计	599,019,509.72	599,331,695.95	312,186.23	0.0322
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	599,019,509.72	599,331,695.95	312,186.23	0.0322
项目		上年度末 2023年12月31日			

		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	6,919,396.31	6,918,291.51	-1,104.80	0.0000
	银行间市场	1,746,309,088.00	1,747,349,846.09	1,040,758.09	0.0361
	合计	1,753,228,484.31	1,754,268,137.60	1,039,653.29	0.0361
资产支持证券		-	-	-	-
合计		1,753,228,484.31	1,754,268,137.60	1,039,653.29	0.0361

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

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 2024年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	308,067,564.58	-
合计	308,067,564.58	-
项目	上年度末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,096,436,507.70	-
合计	1,096,436,507.70	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31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	-	-
应付交易费用	28,172.46	27,735.31
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	28,172.46	27,735.31
应付利息	-	-
预提审计费	35,000.00	35,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提账户维护费	9,000.00	9,000.00
合计	192,172.46	191,735.31

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 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 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	197,506,686.60	197,506,686.60
本期申购	706,044,253.92	706,044,253.92
本期赎回（以“-”号填列）	-777,436,408.99	-777,436,408.99
本期末	126,114,531.53	126,114,531.53

**7.4.7.7.2 天治天得利货币B**

金额单位：人民币元

项目 (天治天得利货币B)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,682,634,273.63	2,682,634,273.63
本期申购	6,795,271,080.29	6,795,271,080.29
本期赎回（以“-”号填列）	-8,634,384,353.40	-8,634,384,353.40
本期末	843,521,000.52	843,521,000.52

**7.4.7.7.3 天治天得利货币C**

金额单位：人民币元

项目 (天治天得利货币C)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	21,395,231.13	21,395,231.13
本期赎回（以“-”号填列）	-21,395,231.13	-21,395,231.13
本期末	-	-

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**7.4.7.8 未分配利润****7.4.7.8.1 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,608,871.82	-	2,608,871.82
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	-2,608,871.82	-	-2,608,871.82
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.8.2 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	9,327,029.50	-	9,327,029.50
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-9,327,029.50	-	-9,327,029.50
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.8.3 天治天得利货币C

单位：人民币元

项目 (天治天得利货币C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	11,231.13	-	11,231.13
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-11,231.13	-	-11,231.13
本期末	-	-	-

**7.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	6,759.03	13,101.52
定期存款利息收入	101,855.54	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	452.10	1,228.00
其他	8,086.46	22.43
合计	117,153.13	14,351.95

**7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

**7.4.7.11 债券投资收益****7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
债券投资收益——利息收入	9,204,873.98	6,894,750.75
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	1,634,691.67	276,285.19
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	10,839,565.65	7,171,035.94

**7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,170,896,526.57	1,427,834,768.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,152,049,265.80	1,420,474,176.30
减：应计利息总额	17,212,569.10	7,084,307.47
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	1,634,691.67	276,285.19

#### 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

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。

#### 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

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。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

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。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

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 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

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。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

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。

**7.4.7.17 其他收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

**7.4.7.18 信用减值损失**

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
审计费用	35,000.00	35,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	26,999.59	30,958.92
账户维护费	36,000.00	36,000.00
开户费	200.00	-
其他	1,200.00	1,200.00
合计	219,399.59	223,158.92

**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，本基金无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
中国吉林森林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

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 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

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。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

###### 7.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。

###### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

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。

#### 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 2024年01月01日至20 24年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	1,459,856.18	874,140.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	355,419.16	122,864.29
应支付基金管理人的净管理费	1,104,437.02	751,276.43

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	364,964.03	218,535.21

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的	本期 2024年01月01日至2024年12月31日

各关联方名称	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	天治天得利货币C	合计
天治基金管理有限公司	7,432.83	185,390.74	67.06	192,890.63
民生银行股份有限公司	1,191.41	0.00	0.00	1,191.41
合计	8,624.24	185,390.74	67.06	194,082.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2023年01月01日至2023年12月31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	天治天得利货币C	合计
天治基金管理有限公司	4,328.35	264,548.29	0.00	268,876.64
中国民生银行股份有限公司	1,637.57	0.00	0.00	1,637.57
合计	5,965.92	264,548.29	0.00	270,514.21

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。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。C类基金份额的年销售服务费率为0.01%，本基金C类基金份额不适用基金份额升降级机制。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，销售服务费的计算方法如下：

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

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。

#### 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

单位：人民币元

本期 2024年01月01日至2024年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行股份有限公司	-	-	-	-	176,000.00	10,197.60
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行股份有限公司	-	-	-	-	164,000.00	14,524.66

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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	上年度可比期间
	2024年01月01日至 2024年12月31日	2023年01月01日至 2023年12月31日
报告期初持有的基金份额	2,501,128.48	-
报告期间申购/买入总份额	16,356.62	2,501,128.48
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	2,517,485.10	-
报告期末持有的基金份额	0.00	2,501,128.48
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.09%

注：1. 本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资天治天得利货币B类基金，本基金的基金管理人本报告期末未运用自有资金投资天治天得利货币C类基金。

2. 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。

#### 7.4.10.5.2 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

天治天得利货币B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023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	0.00	0.00%	31,093,596.31	1.08%

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货币A类基金，本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资天治天得利货币C类基金。

#### 7.4.10.6 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 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	2,658,427.84	23,825.70	397,928.75	13,101.52

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金

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
2,643,640.78	-	-34,768.96	2,608,871.82	-

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
9,862,761.02	-	-535,731.52	9,327,029.50	-

天治天得利货币C

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
11,231.13	-	-	11,231.13	-

#### 7.4.12 期末（2024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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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2024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金融资产款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024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金融资产款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

#### 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。本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下设的合规与风险控制委员会、督察长、经营管理层下设的风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部及各个业务部门组成。

##### 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。本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

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。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

### 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 2024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							
货币资金	2,658,427.84	30,042,122.20	-	-	-	-	32,700,550.04
存出保证金	1,115.28	-	-	-	-	-	1,115.28
交易性金融资产	160,468,885.89	350,465,844.93	88,084,778.90	-	-	-	599,019,509.72
买入返售金融资产	308,067,564.58	-	-	-	-	-	308,067,564.58
应收申购款	-	-	-	-	-	30,276,516.00	30,276,516.00
资产总计	471,195,993.59	380,507,967.13	88,084,778.90	-	-	30,276,516.00	970,065,255.62
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	99,734.61	99,734.61
应付托管费	-	-	-	-	-	24,933.66	24,933.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-	65,793.93	65,793.93
应交税费	-	-	-	-	-	5,170.95	5,170.95
应付利润	-	-	-	-	-	41,917.96	41,917.96
其他负债	-	-	-	-	-	192,172.46	192,172.46
负债总计	-	-	-	-	-	429,723.57	429,723.57
利率敏感度缺口	471,195,993.59	380,507,967.13	88,084,778.90	-	-	29,846,792.43	969,635,532.05
上年度	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

末 2023年 12月31 日							
资产							
货币资金	397,928.75	-	-	-	-	-	397,928.75
结算备付金	9,244.01	-	-	-	-	-	9,244.01
存出保证金	1,149.64	-	-	-	-	-	1,149.64
交易性金融资产	185,232,177.16	1,243,714,758.25	324,281,548.90	-	-	-	1,753,228,484.31
买入返售金融资产	1,096,436,507.70	-	-	-	-	-	1,096,436,507.70
应收申购款	-	-	-	-	-	31,113,394.77	31,113,394.77
资产总计	1,282,077,007.26	1,243,714,758.25	324,281,548.90	-	-	31,113,394.77	2,881,186,709.18
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	123,204.51	123,204.51
应付托管费	-	-	-	-	-	30,801.13	30,801.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	81,471.03	81,471.03
应交税费	-	-	-	-	-	6,118.53	6,118.53
应付利润	-	-	-	-	-	612,418.44	612,418.44
其他负债	-	-	-	-	-	191,735.31	191,735.31
负债总计	-	-	-	-	-	1,045,748.95	1,045,748.95
利率敏感度缺口	1,282,077,007.26	1,243,714,758.25	324,281,548.90	-	-	30,067,645.82	2,880,140,960.23

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

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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	利率上升25个基点	-243,949.14	-637,329.98
	利率下降25个基点	243,949.14	637,329.98

#### 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，且按实际利率计算账面价值，因此无重大市场价格风险。

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
---------------	--------------------	---------------------

第一层次	-	-
第二层次	599,019,509.72	1,753,228,484.31
第三层次	-	-
合计	599,019,509.72	1,753,228,484.31

#### 7.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 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。

##### 7.4.15.2 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。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2025年3月21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	599,019,509.72	61.75
	其中：债券	599,019,509.72	61.75
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	308,067,564.58	31.76
	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	32,700,550.04	3.37
4	其他各项资产	30,277,631.28	3.12
5	合计	970,065,255.62	100.00

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.81	
	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%。

## 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	40
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：报告期内投资组合平均剩余期限没有超过120天的情况。

### 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	48.60	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	34.06	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	5.18	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.89	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	6.19	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	96.92	-

#### 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

本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

#### 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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,095,006.89	0.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,214,966.68	5.28
	其中：政策性金融债	51,214,966.68	5.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	110,751,196.43	11.42

6	中期票据	-	-
7	同业存单	428,958,339.72	44.24
8	其他	-	-
9	合计	599,019,509.72	61.78
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

### 8.6 期末按实际利率计算账面价值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)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112403117	24农业银行CD117	1,500,000	149,660,305.94	15.43
2	112404005	24中国银行CD005	500,000	49,944,906.67	5.15
3	112483101	24徽商银行CD125	500,000	49,941,304.18	5.15
4	112410147	24兴业银行CD147	500,000	49,885,261.27	5.14
5	2303102	23进出102	200,000	20,489,331.00	2.11
6	042480172	24湘高速CP002	200,000	20,280,357.78	2.09
7	012483003	24华侨城SCP003	200,000	20,116,370.68	2.07
8	112409261	24浦发银行CD261	200,000	19,976,973.36	2.06
9	112499708	24徽商银行CD085	200,000	19,936,882.58	2.06
10	150405	15农发05	100,000	10,371,409.77	1.07

### 8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.1221%

报告期内偏离度的最低值	0.0037%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0372%

### 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。

### 8.8 期末按公允价值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

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 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。

**8.9.2** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，**24**中国银行CD005的发行主体在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局的处罚。**24**徽商银行CD125的发行主体在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局安徽监管局的处罚。**24**兴业银行CD147的发行主体在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。**24**徽商银行CD085的发行主体在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局安徽监管局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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	1,115.28
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	30,276,516.00

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	30,277,631.28

#### 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

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	8,499	14,838.75	24,032,398.81	19.06%	102,082,132.72	80.94%
天治天得利货币B	30	28,117,366.68	808,417,924.99	95.84%	35,103,075.53	4.16%
天治天得利货币C	0	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	8,529	113,686.90	832,450,323.80	85.85%	137,185,208.25	14.15%

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。

## 9.2 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	银行类机构	231,937,527.61	23.92%
2	银行类机构	80,002,735.49	8.25%
3	其他机构	34,003,053.85	3.51%
4	其他机构	32,002,788.31	3.30%
5	基金类机构	32,000,000.00	3.30%
6	其他机构	30,694,303.43	3.17%
7	个人	30,098,159.65	3.10%
8	信托类机构	30,000,000.00	3.09%
9	券商类机构	30,000,000.00	3.09%
10	券商类机构	30,001,025.81	3.09%

## 9.3 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	4,100,371.75	3.25%
	天治天得利货币B	0.00	0.00%
	天治天得利货币C	0.00	0.00%
	合计	4,100,371.75	0.42%

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）。

## 9.4 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	0
	天治天得利货币B	0
	天治天得利货币C	0
	合计	0
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
	天治天得利货币C	0
	合计	0

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

	天治天得利货币A	天治天得利货币B	天治天得利货币C
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	197,506,686.60	2,682,634,273.63	-
本报告期基金总申 购份额	706,044,253.92	6,795,271,080.29	21,395,231.13
减：本报告期基金 总赎回份额	777,436,408.99	8,634,384,353.40	21,395,231.13
本报告期期末基金 份额总额	126,114,531.53	843,521,000.52	-

### §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，基金管理人发生以下重大人事变动：

- 1、2024年9月5日，李大伟先生任职公司副总经理。

2、2024年10月11日，许家涵先生离任公司财务负责人，张健先生任职公司财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

### 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。

本报告年度聘任会计师事务所的报酬为3.5万元整。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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	基金管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024年11月25日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	出具警示函的行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	一是在人员任职管理方面存在不足；二是对相关人员的投资行为管理不到位。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人已采取整改措施，加强相关内部控制。
其他	-

报告期内，管理人的高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关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) 有较强的合规风控能力和交易、研究等服务能力，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，提供专业的研究报告；
- (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。

3、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，本公司网站披露的《天治基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）》的报告期为2024年7月1日至2024年12月31日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东北证券	29,817,622.00	100.00%	46,107,000.00	100.00%	-	-	-	-

**11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况**

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旗下部分基金增加万得基金为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2024-01-05
2	天治基金管理有限公司旗下基金增加奕丰基金为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2024-01-15
3	天治基金管理有限公司旗下基金2023年第4季度报告提示性公告、天治旗下十五只基金 2023年第4季度报告汇总	中国证监会指定媒介	2024-01-19
4	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	中国证监会指定媒介	2024-02-06
5	天治基金管理有限公司旗下基金增加宁波银行为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2024-02-23
6	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业	中国证监会指定媒介	2024-03-22

	务并参加费率优惠活动的公告		
7	天治基金管理有限公司旗下基金2023年年度报告提示性公告、天治旗下十五只基金2023年年度报告汇总	中国证监会指定媒介	2024-03-27
8	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	中国证监会指定媒介	2024-04-01
9	天治基金管理有限公司旗下基金2024年第1季度报告提示性公告、天治旗下十五只基金2024年第1季度报告汇总	中国证监会指定媒介	2024-04-20
10	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	中国证监会指定媒介	2024-04-26
11	天治天得利货币市场基金“端午”假期前暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2024-06-05
12	天治天得利货币市场基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2024-06-20
13	天治天得利货币市场基金(B类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2024-06-20
14	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加加和基金为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2024-06-26

15	天治基金管理有限公司旗下部分基金增加国信嘉利为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2024-07-11
16	天治基金管理有限公司旗下基金2024年第2季度报告提示性公告、天治旗下十五只基金2024年第2季度报告汇总	中国证监会指定媒介	2024-07-18
17	关于喜鹊财富基金销售有限公司终止代销天治基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会指定媒介	2024-08-09
18	天治天得利货币市场基金更新的招募说明书(2024年)	中国证监会指定媒介	2024-08-16
19	天治天得利货币市场基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2024-08-16
20	天治天得利货币市场基金(B类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2024-08-16
21	天治基金增加云湾基金为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2024-08-23
22	天治基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	中国证监会指定媒介	2024-08-27
23	天治基金管理有限公司旗下基金2024年中期报告提示性公告、天治旗下十五只基金2	中国证监会指定媒介	2024-08-29

	024年中期报告汇总		
24	天治基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2024-09-05
25	天治基金管理有限公司关于天治天得利货币市场基金增加C类基金份额并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定媒介	2024-09-07
26	天治天得利货币市场基金更新的招募说明书、天治天得利货币市场基金(A类份额)基金产品资料概要更新、天治天得利货币市场基金(B类份额)基金产品资料概要更新天治天得利货币市场基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2024-09-07
27	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	中国证监会指定媒介	2024-09-11
28	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	中国证监会指定媒介	2024-09-26
29	天治基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2024-10-14
30	天治基金管理有限公司旗下基金2024年第3季度报告提示性公告、天治旗下十五只基金2024年3季度报告汇总	中国证监会指定媒介	2024-10-24
31	天治基金管理有限公司旗下基金增加万家财富为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠	中国证监会指定媒介	2024-11-19

	活动的公告		
32	天治基金管理有限公司旗下基金增加华源证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2024-11-29

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20240326-20240326	150,073,838.63	270,135,660.33	420,209,498.96	0.00	0.00%
	2	20240607-20240625	0.00	231,937,527.61	0.00	231,937,527.61	23.92%
	3	20240710-20241231	0.00	231,937,527.61	0.00	231,937,527.61	23.92%
	4	20240620-20240625	0.00	300,711,303.85	300,711,303.85	0.00	0.00%
	5	20240710-20240808	0.00	300,711,303.85	300,711,303.85	0.00	0.00%
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。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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托管协议》
4. 《天治天得利货币市场基金招募说明书》

- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6.报告期内天治天得利货币市场基金公告的各项原稿

### 13.2 存放地点

天治基金管理有限公司办公地点-上海市云锦路701号西岸智塔东塔19楼。

### 13.3 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  
二〇二五年三月二十七日