天治天得利货币市场基金更新的招募说明书(摘要)

(2020年)

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
二〇二〇年八月

重要提示

基金合同生效日期:2006年7月5日

投资有风险,投资者拟申购本基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要依据基金合同和招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除特别说明外,本招募说明书所载内容截止日为2020年7月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2020年6月30日(财务数据未经审计)。本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容,将不晚于2020年9月1日起执行。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

1、名称:天治基金管理有限公司
2、住所:上海市浦东新区莲振路298号4号楼231室
3、成立日期:2003年5月27日
4、法定代表人:单宇
5、办公地址:上海市复兴西路159号
6、电话:021-60371155
7、联系人:赵正中
8、注册资本:1.6亿元人民币
9、股权结构: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%。

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理层成员

单宇先生:董事长,硕士学历,曾任吉林省信托有限责任公司证券投资部经理,吉林省宝路达投资管理有限公司总经理、天治基金管理有限公司筹备组成员,天治基金管理有限公司副总经理、监事长,东北证券副总裁、副总裁兼合规总监,东方基金管理有限公司董事、总经理,东北证券党委副书记,东证融通投资管理有限公司董事长、副董事长,现任天治基金管理有限公司董事长。

徐克磊先生:董事,硕士学历,曾任泰达宏利基金管理有限公司(原湘财合丰基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司)IT部总经理、综合管理部总经理、营销策划部总经理、公司总经理助理兼业务副总监、总经理助理兼新闻发言人,现任天治基金管理有限公司总经理。

张纪军先生:董事,硕士学历,曾任吉林省信托投资有限责任公司自营部业务员、研发部经理、深圳子公司总经理,吉林省亚东投资管理有限责任公司深圳子公司董事长、总公司总经理助理、副总经理,现任吉林森工集团有限责任公司副总经理、吉林森工集团财务有限责任公司董事长。

李巍先生:董事,中共党员,工程师职称。1996年起加入吉林省信托有限责任公司,历任项目经理、信托业务部副总经理、北京信托一部总经理,现任吉林省信托有限责任公司市场总监兼北京信托一部总经理。

武重先生:独立董事,学士,历任北京市政府对外服务办公室、北京市金杜律师事务所律师、北京市金杜律师事务所上海分所合伙人,现任君合律师事务所上海分所合伙人。

王万军先生:独立董事,硕士研究生学历,曾任职于吉林省经济体制改革委员会股份制工作处,中国证监会吉林证监局,历任吉林证监局上市发行处副处长、机构监管处处长、上市公司监管处处长,现任恒泰长财证券有限责任公司合规总监,并获聘担任深圳证券交易所理事会行政复议委员会委员。

周鹏女士:独立董事,法学硕士,曾先后于中国环球律师事务所、金杜律师事务所、盛德国际律师事务所、北京宽信律师事务所担任律师和资深律师,2012年担任中国华安投资有限公司法律顾问,2016年担任中国信达(香港)控股有限公司风险总监兼法律顾问,现为上海耀良律师事务所合伙人,为英国特许会计师公会准会员。

侯丹宇女士:监事会主席(职工监事),学士,经济师职称。历任吉林省信托有限责任公司上海证券业务部营业部经理、东北证券有限责任公司上海洪山路证券营业部总经理、天治基金管理有限公司督察长、副总经理,现任天治基金管理有限公司监事会主席(职工监事)、公司党支部委员、公司工会主席。

牛葵女士:监事,本科学历,高级经济师职称。曾在吉林省信托有限公司量火项目部、证券部、计划财务部、投行部、信托资产管理部工作,现任吉林省信托有限责任公司监察审计部副总经理(主持工作)。

米巍先生:监事,本科学历,中共党员。2008年起加入中国吉林森林工业集团有限责任公司,先后在吉林新合木业、金桥地板集团及吉林森工集团总部工作,现任中国吉林森林工业集团有限责任公司资本运营部副部长。

赵正中先生:职工监事,本科学历,1998年起就职于中国纺织大学,2000年起就职于广发证券股份有限公司,2003年加入天治基金管理有限公司,曾任信息技术部副总监,现任公司监察稽核部总监。

张健先生,职工监事,硕士研究生。2003年起加入天治基金管理有限公司,先后担任综合管理部行政主管、副总监、总监,现任综合管理部总监、公司工会委员。

刘伟先生:督察长,学士,历任吉林省信托有限责任公司量火项目处项目负责人、自营基金业务部副经理、上海金路达创业投资公司董事长,现任天治基金管理有限公司督察长。

闫泽文女士:副总经理,硕士研究生,中共党员,高级经济师职称。1996年至2009年在吉林省信托有限责任公司任职,先后担任团总支书记、自营业务部副经理、经理、证券部经理、市场研发部经理,2009年6月起加入天治基金管理有限公司,曾任公司财务总监、总经理助理、副总经理,现任天治基金管理有限公司副总经理、首席信息官。

2、本基金基金经理

都杰女士:本科,具有基金从业资格,证券从业年限9年。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。2019年8月起加入天治基金管理有限公司。自2019年9月4日起任天治天得利货币市场基金和本基金基金经理。

本基金历任基金经理:自2006年7月5日(基金合同生效日)至2008年6月30日,史向明女士任基金经理;2007年10月25日至2008年8月27日,刘红兵先生任基金经理;2008年6月30日至2010年5月18日,贺云先生任基金经理;2010年4月14日至2012年6月29日,秦炳女士任基金经理;2012年6月29日至2014年1月15日,吴亮谷先生任基金经理;2013年12月10日至2015年3月16日,王泽女士任基金经理;2017年1月24日至2019年3月6日,徐瀛先生任基金经理;2015年3月16日至2019年9月16日,向桂英女士任基金经理。

3、投资决策委员会成员

天治基金管理有限公司总经理徐克磊先生,投资总监兼权益投资部总监许家涵先生,研究总监尹维国先生,投资副总监兼固定收益部总监王泽女士,量化投资部总监TIAN HUAN先生。

4、上述人员之间无亲属关系。

二、基金托管人

名称:中国民生银行股份有限公司(以下简称"中国民生银行")
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
成立时间:1996年2月7日
基金托管业务批准文号:证监基金字[2004]101号
组织形式:其他股份有限公司(上市)
注册资本:28,365,585,227元人民币
存续期间:持续经营
电话:010-58560666
联系人:罗菲菲

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

名称:天治基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区莲振路298号4号楼231室
法定代表人:单宇
办公地址:上海市复兴西路159号
电话:021-60374900
传真:021-60374934
联系人:洪韦芸
客户服务电话:400-098-4800(免长途通话费用)、021-60374800
网址:www.chinanature.com.cn
电子直销:天治基金网上交易平台"E天网"
网址:https://etrade.chinanature.com.cn/etrading/etrading.jsp

2、代销机构

(1)中国民生银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
电话:010-57092615
传真:010-57092611
联系人:杨成茜
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

(2)中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:田国立
电话:010-66275654
传真:010-66275654
联系人:王琳
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

(3)交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:任德奇
电话:021-58781234
传真:021-58408483
联系人:王菁
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(4)中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:李庆萍
电话:010-65558888
传真:010-65550827
联系人:郭伟
客户服务电话:95558
网址:www.bank.ecitic.com

(5)中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:娄建清
电话:010-66107900
传真:010-66107914
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn

(6)中国农业银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:周慕冰
传真:010-85109219
联系人:贺倩
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com、www.95599.cn

(7)北京银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街甲17号北京银行大厦
法定代表人:张东宁
电话:010-66223584
传真:010-66226045
联系人:王曦
客户服务电话:95526
网址:http://www.bankofbeijing.com.cn

(8)上海浦东发展银行股份有限公司
住所:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:郑杨
电话:021-61618888
传真:021-63604199
联系人:倪苏云
客户服务电话:95528
网址:www.spdb.com.cn

(9)上海银行股份有限公司
住所:上海市银城中路168号
办公地址:上海市银城中路168号
法定代表人:金煜
电话:021-68475888
传真:021-68476111
联系人:汤征程
客户服务电话:95594
网址:http://www.bosc.cn/

(10)浙商银行股份有限公司
住所:浙江杭州市庆春路288号
办公地址:浙江杭州市庆春路288号
法定代表人:张达洋
电话:0571-87659546
传真:87569188
联系人:毛真海
客户服务电话:95527
网址:http://www.czbank.com/czbank/

(11)吉林银行股份有限公司
注册地址:吉林省长春市东南湖大路1817号
办公地址:吉林省长春市东南湖大路1817号
法定代表人:张宝祥
联系人:孟明
电话:0431-84992680
传真:0431-84992649
客服电话:4008896666
网址:www.jlbank.com.cn

(12)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈共炎
电话:010-83574507
传真:010-83574807
联系人:辛国政
客户服务电话:4008-888-888或95551
网址:www.chinastock.com.cn

(13)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦
法定代表人:贺青
联系电话:021-38676666
传真:021-38670666
联系人:钟伟镇
服务热线:95521 / 4008888666
网址:www.gtja.com

(14)海通证券股份有限公司
住所:上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦
办公地址:上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦
法定代表人:周杰
电话:021-23219000
联系人:李笑鸣
客户服务电话:95553
网址:www.htsec.com

(15)中信建投证券股份有限公司
住所:北京市安立路66号4号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街188号
法定代表人:王常青
电话:010-85156398
联系人:许梦园
客服电话:95587、4008-888-108
网址:www.csc108.com

(16)申万宏源证券有限公司
住所:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:杨玉成
电话:021-33389888
传真:021-33388224
联系人:黄莹
客户服务电话:95523或4008895523
网址:www.swhysc.com

(17)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区福田街道福华一路11号
办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路11号
法定代表人:霍达
电话:0755-82943666
传真:0755-83734343
联系人:黄婵君
客户服务电话:95565、4008888111
网址:www.newone.com.cn

(18)华泰证券股份有限公司
住所:南京市江东中路228号
办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场
法定代表人:张伟
电话:021-50531281
传真:021-83387254
联系人:庞晓芸
客户服务电话:95597
网址:www.htsc.com.cn

(19)兴业证券股份有限公司
住所:福建省福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人:杨华辉
电话:021-38565547
联系人:乔琳雪
客户服务电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn

(20)东方证券股份有限公司
住所:上海市中山南路318号2号楼22-29楼
办公地址:上海市中山南路318号新源广场2号楼22-29楼
法定代表人:潘鑫军
电话:021-63325888
联系人:吴宇
客户服务电话:95503
网址:www.dfzq.com.cn

(21)金元证券股份有限公司
住所:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼
法定代表人:王作义
电话:0755-83025022
传真:0755-83025625
联系人:刘萍
客户服务电话:95372
网址:www.jyzq.com.cn

(22)中泰证券有限责任公司
住所:山东省济南市经七路86号
办公地址:上海市花园石桥路66号东亚银行金融大厦18层
法定代表人:李玮
电话:021-20315290
传真:0531-68889095
联系人:秦雨晴
客户服务电话:95538
网址:http://www.zts.com.cn/

(23)长江证券股份有限公司
住所:武汉新华路特8号长江证券大厦
办公地址:武汉新华路特8号长江证券大厦
法人代表:李新华
电话:027-65799999
传真:027-85481900
联系人:奚博宇
客户服务电话:95579、4008888999
网址:www.95579.com

(24)东北证券股份有限公司
住所:长春市生态大街6666号
办公地址:长春市生态大街6666号
法定代表人:李福春
电话:0431-85096517
联系人:安岩岩
客户服务电话:95360
网址:www.nesc.cn

(25)第一创业证券有限责任公司
住所:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
法定代表人:刘学民
电话:0755-23838751
传真:0755-23838999-8751
联系人:吴军
客户服务电话:95358
网址:www.firstcapital.com.cn

(26)山西证券股份有限公司
住所:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
电话:0351-8686659
传真:0351-8686667
联系人:郭煜
客户服务电话:400-666-1618、95573
网址:www.i618.com.cn

(27)华安证券股份有限公司
住所:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
法定代表人:章宏韬
电话:0551-65161821
传真:0551-65161600
联系人:范超
客户服务电话:95318
网址:www.hazq.com

(28)万联证券有限责任公司
住所:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址:广东省广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E座12层
法定代表人:罗欲斌
电话:021-38286026
传真:020-38286862
联系人:甘蕾
客户服务电话:95322
网址:www.wlzq.com.cn

(29)光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:周健男
电话:021-22169999
传真:021-22169134
联系人:何耀
客户服务电话:95525
网址:www.ebscn.com

(30)国元证券股份有限公司
住所:安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座
办公地址:安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座
法定代表人:凤良志
电话:0551-2272101
联系人:李蔡
客户服务电话:95578
网址:www.gyzq.com.cn

(31)广发证券股份有限公司
住所:广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦
法定代表人:孙树明
电话:020-66338888
联系人:马梦洁
客户服务电话:95575
网址:www.gf.com.cn

(32)财富证券有限责任公司
住所:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人:孙永祥
电话:021-38784580-8920
传真:021-68865680
联系人:江恩前
客户服务电话:95351
网址:www.xcsc.com

(33)平安证券有限责任公司
住所:深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层
办公地址:深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层
法定代表人:何之江
传真:0755-82400826
联系人:周驰
客户服务电话:95511-8
网址:www.pingan.com.cn

(34)天信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:王连志
电话:0755-82558305
传真:0755-82558355
联系人:陈剑虹
客户服务电话:4008001001
网址:www.essences.com.cn

(35)申万宏源西部证券有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:李琦
电话:0991-2307105
传真:0991-2301927
联系人:王怀春
客户服务电话:4008000562
网址:www.hysec.com

(36)爱建证券有限责任公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
法定代表人:祝健
电话:021-32229888
联系人:陈威
客户服务电话:4001962502
网址:www.ajzq.com

(37)东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:钱俊文
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:王一彦
客服电话:95531;400-8888-588
网址:www.longone.com.cn

(38)新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:叶顺德
电话:010-83561000
传真:010-83561001 联系人:田芳芳
客户服务电话:95399 网址:www.xsdzq.cn

(39)国联证券股份有限公司
住所:无锡市县前东街168号
办公地址:无锡市金融一街8号
法定代表人:姚志勇
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
联系人:祁昊
客户服务电话:95570
网址:www.gjsc.com.cn

(40)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法人代表:肖林
电话:010-63080100
传真:010-63080144
联系人:唐静
客户服务电话:95321
网址:www.cindasc.com

(41)天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人:林义相
电话:010-66045608
传真:010-66045500
联系人:林爽
客户服务电话:010-66045678
网址:www.txsec.com、www.jjm.com.cn

(42)华福证券有限责任公司
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1088号招商银行大厦18楼
法定代表人:黄金琳
电话:021-20655017
传真:021-20655196
联系人:刘晨
客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)
网址:http://www.hfzq.com.cn

(43)中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场二期北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:张佑君
电话:010-60838696
传真:010-60833739
联系人:杜杰
客户服务电话:95548
网址:www.cs.ecitic.com

(44)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人:姜晓林
基金业务联系人:焦刚
电话:0531-89606166
传真:0532-85022605
客户服务电话:95548
公司网址:sd.citics.com

(45)国海证券股份有限公司
住所:广西桂林市辅星路13号
办公地址:广西南宁市滨湖路46号国海大厦
法定代表人:何春梅
电话:0755-83709350
传真:0755-83704850
联系人:牛孟宇
客户服务电话:95563
网址:www.ghzq.com.cn

(46)太平洋证券股份有限公司
住所:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址:北京市西城区北展北街九号华远企业号D座三单元
法定代表人:郑亚南
电话:010-88321875
传真:010-88321763
联系人:王婧
客户服务电话:95397
网址:www.tpyzq.com

(47)华龙证券有限责任公司
注册地址:兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
办公地址:兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
组织形式:股份有限公司
法定代表人:陈牧原
电话:0931-4890208
传真:0931-4890628
基金业务联系人:范坤
客户服务电话:95368
公司网址:www.hlzq.com

(48)中天证券有限责任公司
注册地址:沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址:沈阳市和平区光荣街23甲
法定代表人:马功勋
基金业务联系人:孙丹华
电话:024-2328 0839
传真:024-2284 2073
客户服务电话:95346
公司网址:www.iztzq.com

(49)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房
办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人:俞洋
电话:021-64339000
传真:021-54967293
联系人:杨莉娟
业务联系电话:021-54967552
客户服务电话:95323、4001099918(全国)、029-68918888
华鑫证券公司网站:www.cfsc.com.cn

(50)中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
办公地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
法定代表人:黄扬录
电话:0755-82943755
传真:0755-82960582
联系人:罗艺琳
客户服务电话:95329
网址:www.zszq.com

(51)和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王荆
电话:010-85657353
传真:021-20835885
联系人:陈慧
客户服务电话:400-920-0022
网址:http://licaike.hexun.com/

(52)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
法定代表人:汪静波
电话:021-38602377
传真:021-38509777
联系人:邱佳捷
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com

(53)上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号26楼
法定代表人:其实
电话:021-54509988
传真:021-64385308
联系人:王维
客户服务电话:4001818188
网址:www.1234567.com.cn

(54)上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
电话:021-36696312
传真:021-68596916
联系人:高源
客户服务电话:4007009665
网址:www.ehowbuy.com

(55)上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
电话:021-2069-1935
传真:021-20691861
联系人:党敏
客户服务电话:400-089-1289
网址:www.erichfund.com

(56)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:祖国明
电话:0571-26888888
传真:0571-26698533
联系人:何倩
客服电话:4000 766 123
网址:www.fund123.cn

(57)浦领基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京东园4区13号楼A座9层908室
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人:聂婉君
联系人:李艳
电话:010-59497361
传真:010-64788016
客服电话:400-012-5899
公司网站:www.zscffund.com

(58)深圳众禄基金销售股份有限公司
住所:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址:深圳市罗湖区梨园路Halo广场4楼
法定代表人:薛峰
电话:0755-33227950
传真:0755-33227951
联系人:袁江江
客户服务电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn www.jmmw.com

(59)北京钱景财富投资管理有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
电话:010-59158135
传真:010-57569671
联系人:曹金宝
客户服务电话:400-678-5095
网址:www.niuji.net

(60)北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
电话:010-59601366
传真:010-62020355
联系人:吴志花
客户服务电话:400-888-6661
网址:www.myfund.com

(61)宜信普泽(北京)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人:沈伟桦
电话:010-52413385
传真:010-85894285
联系人:魏晨
客户服务电话:400-6099-200
网址:www.yixinfund.com

(62)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
住所:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303\
法定代表人:王岩
电话:010-59200855
传真:010-59200800
联系人:胡明会
客户服务电话:400-819-9868
网址:www.tdyhfund.com

(63)浙江同花顺基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
电话:0571-88911818
传真:0571-86800423
联系人:李玲珍
客户服务电话:4008-773-772
网址:www.5ifund.com

(64)上海陆金所资产管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
电话:021-20665952
传真:021-22066653
联系人:程晨
客户服务电话:4008219031
网址:http:// www.lufunds.com/

(65)大泰金石投资管理有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15层
法定代表人:袁顾明
联系人:张永辉
电话:021-58373275
传真:021-20324199
客服电话:400-928-2266
网址:www.dtfunds.com

(66)上海联泰基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
电话:400-118-1188
传真:021-52975270
客服电话:400-166-6788
网址:www.66zichan.com

(67)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市昆明路518号北美广场A1002室
法定代表人:王翔
联系人:居晓菲
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客服电话:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.cn

(68)上海有鱼基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道2023号3层3E-2655室
办公地址:上海市桂平路391号新漕河泾国际商务中心A座5楼
法定代表人:林琼
联系人:徐海峥
电话:021-64389188
传真:021-64389188-102
客服电话:4007676298
网址:www.youyufund.com

(69)北京植信基金销售有限公司
注册地址:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人:于龙
联系人:张喆
电话:010-56075718
传真:010-67766715
网址:www.zhixin-inv.com

(70)上海钜派钰茂基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区泥城镇新城路2号24幢N3187室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路379号14楼C座
法定代表人:杨雅琴
电话:021-68670358
联系人:洪思爽
客户服务电话:4006-889-967
网址:www.jp-fund.com

(71)济安财富(北京)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人:杨健
电话:010-65309516
传真:010-65330699
联系人:李海燕
客户服务电话:4006-737-010
网址:www.jianfortune.com

(72)上海利得基金销售有限公司
住所:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场18层
法定代表人:李兴春
电话:18918352892
传真:021-61101630
联系人:徐亮
客户服务电话:95733
网址:www.leadbank.com.cn

(二)注册登记机构

名称:天治基金管理有限公司
办公地址:上海市徐汇区复兴西路159号
法定代表人:单宇
电话:021-60374960
传真:021-60374974
联系人:黄宇星

(三)律师事务所

名称:上海源泰律师事务所
住所:上海浦东南路256号华夏银行大厦14层
负责人:廖海
经办律师:廖海 田卫红
电话:021-51150298
联系人:廖海

(四)会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
法定代表人:毛鞍宁
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼
签章会计师:蒋燕华、石静筠
电话:021-22288888
传真:021-22280000
联系人:蒋燕华

四、基金的名称

天治天得利货币市场基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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。

八、基金的投资策略

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(投资流程图见图1)。基金的总体投资策略包括以下层面:

1.基金资产配置

(1)市场利率预期

本基金依据与利率变化相关性较强的经济增长、外贸、投资、消费、物价指数等指标进行宏观经济周期及货币政策目标研究。此外还研究以下影响货币市场资金供求关系的事项,预期市场利率的变动方向:

①央行公开市场操作的方向、强度、频率及中标利率水平变化;

②货币供应量、货币乘数变化,商业银行存贷款变化、超额备付率变化;

③资金年末、年初偏紧、年中相对宽松的一般季节性变化;

④新股发行、新债缴款、股市爆发性行情引起的短期资金供求关系变化;

⑤利率市场化改革的推进进程。

(2)组合剩余期限管理

在市场利率预期的基础上,预期市场利率上升时,缩短投资组合的平均剩余期限,预期市场利率下降时,延长投资组合的平均剩余期限。根据货币市场收益率曲线形状的变化预期,采用总收益分析法以子弹组合、杠铃组合或梯形组合安排投资组合的现金流分布。

(3)收益率利差分析

正确评估各投资品种的流动性利差,信用利差,依据市场供求关系及市场环境变化引发的利差变化趋势分析,确定国债、金融债、央行票据、企业债、企业短期融资券以及债券回购间的类属配置。

基金主要投资对象国债、金融债、央行票据均属高信用等级的债券,信用利差相对稳定且易于评估,企业债信用利差通过产业分析、企业分析、财务分析、资金投向分析和债券保护条款分析确定。

流动性利差主要通过比较类别资产平均收益率、收益率波动度、二级市场存量、月均交易量、月均交易量变动等指标加以判断。

2.基金资产选择

在资产配置比例基本确定的基础上,本基金选择剩余期限和信用等级符合标准、流动性高、价值被低估的投资品种。其中,资产流动性通过二级市场存量、日均交易量、上市时间等指标加以判断,资产价值通过利率期限结构、持有期总收益等指标评价。

3、为了在低风险基础上提高基金的收益和保持投资组合充分的流动性,本基金投资管理中还贯穿使用以下策略:

(1)无风险套利策略

无风险套利策略主要包括跨市场套利与跨品种套利策略。

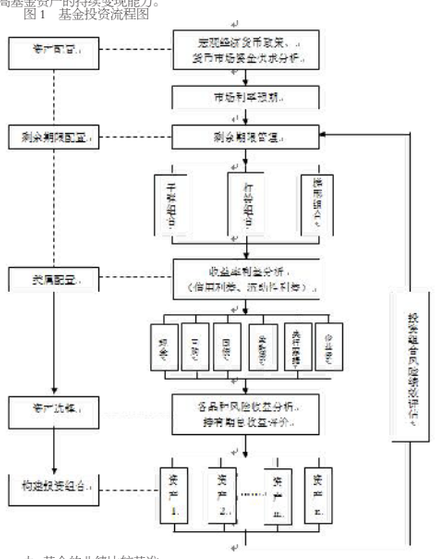
跨市场套利针对各细分投资市场因投资主体、交易方式等不同导致的资产定价偏离,进行套利操作,在低风险的基础上获得超额收益。

跨品种套利针对品种间因流动性、税收等不同导致的资产定价偏离,进行套利操作,在低风险的基础上获得超额收益。

(2)现金流预算管理策略

结合市场利率预期及未来现金流供给与需求的预测,在投资组合的构建中,采用合理的期限和权重配置对现金流进行预算管理,保持投资组合的高流动性。对回购、央行票据等部分投资品种,将依据其市场特性,采用滚动投资策略,以提高基金资产的持续变现能力。

图1 基金投资流程图



九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为银行6个月定期储蓄存款利率(税后)。

十、基金的风险收益特征

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用于等级高、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。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据基金合同规定,复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2020年6月30日。所列财务数据未经审计,取自本基金2020年第2季度报告。

1、报告期末基金资产组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	199,856,728.47	73.60
	其中:债券	199,856,728.47	73.60
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	69,872,521.11	25.73
	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	1,235,452.60	0.45
4	其他资产	594,425.65	0.22
5	合计	271,559,127.83	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)		
1	报告期内债券回购融资余额	0.35		