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）

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

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。

本次更新的招募说明书已经本基金托管人中国民生银行股份有限公司复核，除特别说明外，本次更新的招募说明书所载内容截止日为2009年1月5日，有关财务数据和净值表现截止日为2008年12月31日(财务数据未经审计)。

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：上海市延平路83号501–503室
3、成立日期：2003年5月27日
4、法定代表人：赵玉彪
5、办公地址：上海市复兴西路159号
6、电话：021–64371155
7、联系人：张丽红
8、注册资本：1.3亿元人民币

9、股权结构：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%。

10、简要情况介绍：天治基金公司下设投资管理部、研究发展部、定量研究部、市场营销部、机构理财部、基金结算部、信息技术部、监察稽核部和综合管理部共九个职能部门以及北京分公司。目前公司共管理六只开放式基金，分别是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和本基金。天治财富增长基金于2004年6月29日基金合同生效，托管行为上海浦东发展银行。天治品质优选基金于2005年1月12日基金合同生效，托管行为中国民生银行。天治核心成长基金于2006年1月20日基金合同生效，托管行为交通银行。天治创新先锋基金于2008年5月8日基金合同生效，托管行为交通银行。天治稳健双盈债券型证券投资基金于2008年11月5日基金合同生效，托管行为中国农业银行。本基金于2006年7月5日基金合同生效，托管行为中国民生银行。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理层成员

赵玉彪先生：董事长，硕士，历任吉林省信托投资公司上海证券业务部交易部经理、吉林省信托投资公司上海洪山路证券营业部经理兼驻上海证券交易所出市代表、上海金路达投资管理有限公司总经理，现任天治基金管理有限公司董事长。

高福波先生：董事，研究生学历，高级经济师。历任吉林省白山市人民银行科长、办公室主任、副行级助理稽察员，吉林省白山市农村信用联社理事长，吉林省农村信用联社资金信贷处负责人、副主任，现任吉林省信托投资有限责任公司党委书记、董事长。

邱荣生先生：董事，研究生学历，高级经济师。历任吉林省财政厅预算处科员、科长、副处长，香港振兴投资公司副总经理，吉林省财政厅副主任，吉林省信托投资公司工作办公室主任、财务部经理、总经理助理、副总经理，现任吉林省信托投资有限责任公司党委副书记、董事、总经理。

祖煜先生：董事，总经理，硕士，历任原上海万国证券公司国际业务部高级项目经理、安徽省证券公司国际业务部负责人、广发证券股份有限公司国际业务部副总经理、广发中外合资基金筹备负责人、天治基金管理有限公司副总经理，现任天治基金管理有限公司总经理。

陶武平先生：独立董事，硕士，历任上海市司法学校教务科长、上海市联合律师事务所律师、上海浦东律师事务所律师，现任上海申达律师事务所主任。

张屹山先生：独立董事，学士，历任吉林大学数学系助教、吉林大学经济管理学院讲师、副教授，现任吉林大学商学院教授、商学院院长。

武雷先生：独立董事，学士，曾任北京金杜律师事务所担任执业律师、合伙人，现任君合律师事务所合伙人。

侯丹宇女士：监事长，学士，历任吉林省信托投资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长。

蔡兴龙先生：监事，高级会计师，曾任职于吉林省林业厅财务处科员、吉林森林工业集团有限责任公司集团财务审计部部长，现任吉林森工集团财务公司总经理。

尹维忠先生：监事，学士，2005年起就职于天治基金管理有限公司，现任天治基金管理有限公司基金结算部总监助理。

刘伟先生：督察长，学士，历任吉林省信托投资有限责任公司星火项目处项目负责人、自营基金业务部副经理、上海全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。

2、本基金基金经理

贺云先生：经济学学士，证券从业经验多年。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，2008年7月1日起任本基金基金经理。2008年11月5日起兼任天治稳健双盈债券型证券投资基金基金经理。

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。

3、投资决策委员会成员

总经理祖煜先生、投资管理部总监、天治品质优选混合型证券投资基金基金经理兼天治财富增长证券投资基金基金经理谢京先生、研究发展部总监兼天治核心成长股票型证券投资基金（LOF）基金经理吴涛先生。

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
住所：北京市西城区复兴门内大街2号
成立日期：1996年2月7日
注册资本：10,165,866,029元
法定代表人：董文标
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
托管部门联系人：辛洁
联系电话：010–58560666

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
办公地址：上海市徐汇区复兴西路159号
法定代表人：赵玉彪
电话：021–64718300
传真：021–64375409
联系人：陈楠
客户服务电话：4008864800、021–34064800
网址：www.chinanature.com.cn

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：董文标
电话：010–58351666
传真：010–83914283
联系人：李群
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(长安兴融中心)
法定代表人：郭树清
传真：010–66275654
联系人：何奕
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
法定代表人：蒋超良
电话：021–58781234
传真：021–58408483
联系人：曹榕
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

（4）中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
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：肖时庆
电话：010–66568047
联系人：李洋
客户服务电话：4008888888
网址：www.chinastock.com.cn

（5）国泰君安证券股份有限公司
住所：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人：祝幼一
联系人：芮敏祺
客户服务电话：4008888666
网址：www.gtja.com

（6）海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
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：王开国
联系人：金芸
客户服务电话：95553、4008888001
网址：www.htsec.com

（7）中信建投证券有限责任公司
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：张佑君
联系人：权唐
客户服务电话：400–8888–108
网址：www.csc108.com

（8）申银万国证券股份有限公司
住所：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
电话：021–54033888
传真：021–54035333
联系人：王序微
客户服务电话：021–962505
网址：www.sw2000.com.cn

（9）招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：宫少林
电话：0755–82943666
传真：0755–82943636
联系人：黄健
客户服务热线：95565、4008888111
网址：www.newone.com.cn

（10）华泰证券股份有限公司
住所：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025–84457777–638
联系人：樊昊
客户服务电话：025–84579897
网址：www.htsc.com.cn

（11）兴业证券股份有限公司
住所：福建省福州市湖东路99号标力大厦
办公地址：上海市浦东陆家嘴东路166号中保大厦19楼
法定代表人：兰荣
联系人：杨盛芳
客户服务电话：021–68419393转1098
网址：www.xyzq.com.cn

（12）东方证券股份有限公司
住所：上海市中山南路318号新源广场2号楼21–29楼
办公地址：上海市中山南路318号新源广场2号楼21–29楼
法定代表人：王益民
电话：021–63325888
联系人：吴宇
客户服务电话：95503
网址：www.dfzq.com.cn

（13）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：陆涛
电话：0755–83025695
传真：0755–83025625
联系人：张萍
客户服务电话：4008–888–228
网址：www.jyzq.cn

（14）齐鲁证券有限公司
住所：山东省济南市经十路128号
办公地址：山东省济南市千佛山路三号济南商业银行四层
法定代表人：李玮
电话：0531–81283906
传真：0531–81283900
联系人：傅咏梅
客户服务电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

（15）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：上海市汉口路130号长江证券大厦5F
法人代表：胡运钊
电话：021–63219781
传真：021–51062920
联系人：李良
客户服务电话：4008888999
网址：www.95579.com

（16）东北证券股份有限公司
住所：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
电话：0431–85096709
联系人：潘锴
客户服务电话：0431–96688–0、0431–85096733
网址：www.nesc.cn

（17）第一创业证券有限责任公司
住所：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人：刘学民
电话：0755–25832583
联系人：徐菁
客户服务电话：15915477192、0755–25832523
网址：www.firstcapital.com.cn

（18）山西证券股份有限公司
住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心
法定代表人：侯巍
联系人：张治国
客户服务电话：4006661618
网址：www.i618.com.cn

（19）华安证券有限责任公司
住所：安徽省合肥市长江中路357号
办公地址：安徽省合肥市阜南路166号润安大厦2805号
法定代表人：李工
电话：0551–5161666
联系人：唐泳
客户服务电话：0551–5161671
网址：www.huaans.com

（20）万联证券有限责任公司
住所：广州市中山二路18号广东电信广场36—37层
办公地址：广州市中山二路18号广东电信广场36—37层
法定代表人：李舫金
电话：020–37865026
传真：020–37865030
联系人：李俊
客户服务电话：400–8888–133
网址：www.wlzq.com.cn

（21）光大证券有限责任公司
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：徐浩明
联系人：刘晨
客户服务电话：10108998
网址：www.ebscn.com

（22）国元证券股份有限公司
住所：合肥市寿春路179号
办公地址：合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
联系电话：0551–2207936
联系人：程维
开放式基金咨询电话：安徽地区：96888；全国：400–8888–777
网址：www.gyzq.com.cn

（23）广发证券股份有限公司
住所：广东省珠海市吉大海滨南路光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址：广州市天河北路183号大都会广场42、41、38、36、18、19楼
法定代表人：王志伟
联系人：肖中梅
客户服务电话：020–87555888
网址：www.gf.com.cn

（24）湘财证券有限责任公司
住所：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：上海市浦东陆家嘴环路958号华能联合大厦5楼
法定代表人：陈学荣
电话：021–68634518
传真：021–68865680
联系人：钟康莺
开放式基金客服电话：400–888–1551
网址：www.xcsc.com

（25）平安证券有限责任公司
住所：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦
办公地址：深圳市八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人：陈敬达
电话：0755–82450826
传真：0755–82433794
联系人：袁月
客户服务电话：95511
网址：www.pa18.com

（26）上海远东证券有限公司
住所：上海市浦东南路256号华夏银行大厦5楼
办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦5楼
法定代表人：田德军
联系人：高滋生
客户服务电话：021–58781367
网址：www.ydstock.com

（27）安信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址：深圳市深南大道2028号中国凤凰大厦1号楼7层
法定代表人：牛冠兴
电话：010–66581666
传真：010–66581686
联系人：温鹏
客户服务电话：4008001001
网址：www.essences.com.cn

（28）宏源证券股份有限公司
住所：新疆乌鲁木齐市建设路2号
办公地址：北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层
法定代表人：汤世生
电话：010–62294608
传真：010–62296854
联系人：李茂俊
客户服务电话：010–62294600
网址：www.hysec.com

（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：赵玉彪
电话：021–64371155
传真：021–64715377
联系人：周义

（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
法定代表人：葛明
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址：上海市长乐路989号世纪商贸广场23楼
签章会计师：徐艳、蒋燕华
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。

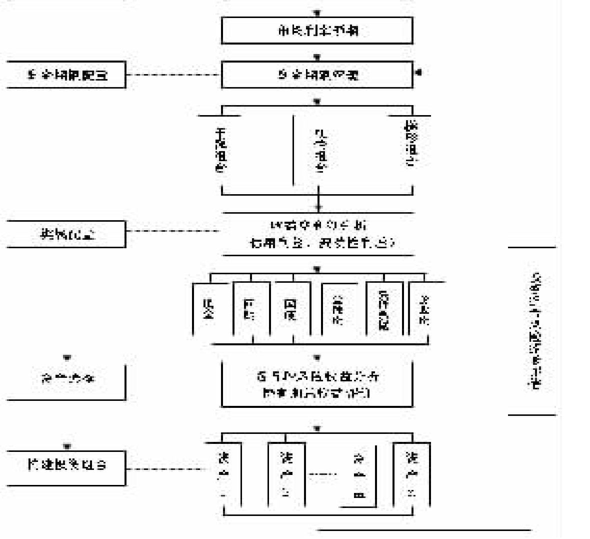
跨市场套利针对各细分投资市场因投资主体、交易方式等不同导致的资产定价偏离，进行套利操作，在低风险的基础上获得超额收益。

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。

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取自本基金2008年第4季度报告。所列财务数据未经审计。

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	980,693,442.16	53.46
	其中：债券	980,693,442.16	53.46
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	–	–
	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	840,010,793.48	45.79
4	其他资产	13,908,987.83	0.76
5	合计	1,834,613,223.47	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	3,058,392,823.30	3.29
	其中：买断式回购融资	–	–
2	报告期末债券回购融资余额	–	0.00
	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。

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%。

3、基金投资组合平均剩余期限

（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	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	194
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2008–10–14	194	基金出现大额申购，当日买入T+1交收债券，导致剩余期限超过180天。	1个工作日

（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	52.36	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)—60天	9.84	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.54	0.00
3	60天(含)—90天	17.99	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.29	0.00
4	90天(含)—180天	9.32	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.39	0.00
5	180天(含)—397天（含）	9.78	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	99.29	0.00

4、报告期末债券投资组合

（1）按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	418,144,211.17	22.80
3	金融债券	221,031,182.02	12.05
	其中：政策性金融债	120,275,249.51	6.56
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	341,518,048.97	18.62
6	其他	0.00	0.00
7	合计	980,693,442.16	53.48
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	150,782,677.91	8.22

注：上表中，附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。

（2）基金投资前十名债券明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	0801028	08央行票据28	1,000,000	99,619,876.73	5.43
2	0801114	08央行票据114	1,000,000	98,967,210.76	5.40
3	0801013	08央行票据13	900,000	89,923,955.67	4.90
4	040705	04建行03浮	800,000	80,534,946.18	4.39
5	0801025	08央行票据25	800,000	79,726,287.76	4.35
6	0881042	08美的CP01	500,000	50,335,872.61	2.74
7	060403	06农发03	500,000	50,246,782.73	2.74
8	0881188	08中普天CP01	500,000	50,231,909.33	2.74
9	0801031	08央行票据31	500,000	49,906,880.25	2.72
10	080303	08进出03	400,000	40,167,333.41	2.19

5、"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	49次
报告期内偏离度的最高值	0.4606%
报告期内偏离度的最低值	0.1069%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3039%

（六）投资组合报告附注

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。

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。

3、本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

4、本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5、其他资产的构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	13,908,987.83
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	其他	–
7	合计	13,908,987.83

十二、基金的业绩

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率比较表：

阶段	净值增长率（1）	净值增长率标准差（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）
2006年7月5日–2006年12月31日	0.9511%	0.0011%	0.8699%	0.0002%	0.0812%	0.0009%
2007年1月1日–2007年12月31日	2.7535%	0.0054%	2.4441%	0.0017%	0.3094%	0.0037%
2008年1月1日–2008年12月31日	3.3773%	0.0093%	3.4340%	0.0011%	–0.0567%	0.0082%

十三、费用概览

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.33\% \div 当年天数$

H为每日计提的基金管理费

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）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div 当年天数$

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。

（3）基金销售服务费

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。本基金的销售服务费按基金资产净值的0.25%年费率计算，销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div 当年天数$

H为每日应计提的销售服务费

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。

若遇不可抗力致使无法按时支付上述基金管理费、基金托管费、基金销售服务费的，顺延至最近可支付日支付。

证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金合同生效后的会计师费和律师费、基金份额持有人大会费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，从基金财产中支付。

2、与基金销售有关的费用

（1）申购费

本基金的申购费率为零。

（2）赎回费

本基金的赎回费率为零。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理方法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金2008年8月19日公布的《天治天得利货币市场基金招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在"基金管理人"中，对基金管理人的基金经理、投资决策委员会成员信息进行了更新。

2、在"基金托管人"中，对基金托管人的业务发展情况、托管基金规模等信息进行了更新。

3、在"相关服务机构"中，更新了代销机构的联系人等相关信息，增加了广发证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、上海远东证券有限公司、安信证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司的有关信息，更新了会计师事务所的相关信息。

4、在"基金份额的申购与赎回"中，增加了基金转换的计算公式等内容。

5、在"基金的投资"中，更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。

6、在"基金的业绩"中，更新了基金合同生效以来的投资业绩。

7、在"对基金份额持有人的服务"中，更新了相关服务内容。

8、在"其他应披露事项"中，列出了自2008年7月6日至2009年1月5日期间与本基金和本基金管理人有关的公告。

天治基金管理有限公司
2009年2月19日

华安基金管理有限公司
关于董事变更的公告

经华安基金管理有限公司（简称"本公司"）股东会审议通过，选举冯祖新先生担任本公司董事，辜昌基先生不再担任本公司董事。

上述董事变更已报中国证监会上海证监局备案。

特此公告。

华安基金管理有限公司
2009年2月19日

附件：冯祖新先生简历

冯祖新先生，研究生学历。历任上海市经济委员会办公室副主任科员、主任科员，上海市经济委员会办公室副主任、主任，上海市工业投资公司副总经理、总经理，上海工业投资（集团）有限公司副总裁、总裁、法定代表人、党委副书记。

证券代码：002097 证券简称：山河智能 公告编号：2009–002

湖南山河智能机械股份有限公司
关于子公司变更名称及
注册资本的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

2009年2月12日，经无锡市江阴工商行政管理局核准，公司全资子公司"无锡方展机械制造有限公司"名称变更为"无锡河山液压机械制造有限公司"，同时注册资本由14,345,628元增加至29,345,628元。

无锡方展机械制造有限公司是公司于2007年9月27日以3,776万元的价格从方展国际集团（香港）有限公司收购的（内容详见2007年9月28日公告），并于2008年10月22日由公司向其追加投资1,500万元（内容详见2008年10月23日公告）。

特此公告。

湖南山河智能机械股份有限公司
二〇〇九年二月十九日

国联安基金管理有限公司关于
国联安德盛增利债券证券投资基金
增加宏源证券为代销机构的公告

根据国联安基金管理有限公司（以下简称"本公司"）与宏源证券股份有限公司（以下简称"宏源证券"）签署的 [illegible]，自2009年2月19日起，宏源证券将代理销售国联安德盛增利债券证券投资基金（基金代码：A类253020 B类253021）[illegible]。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

1.国联安基金管理有限公司
国联安基金客户服务热线：021–38784766，400–7000–365（免长途话费）
国联安基金网站：http://www.gtja-allianz.com

2.宏源证券股份有限公司
宏源证券客户服务热线：4008–000–562
宏源证券网站：http://www.hysec.com

欢迎广大投资者垂询，办理本公司旗下的开放式基金的开户、认(申)购和赎回等相关业务。

特此公告。

国联安基金管理有限公司
二〇〇九年二月十九日

证券简称：*ST嘉瑞 证券代码：000156 公告编号：2009–010

湖南嘉瑞新材料集团股份有限公司
关于召开2009年第一次临时
股东大会补充通知

本公司及其董事、监事、高级管理人员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本公司于2009年3月1日（星期日）上午10时召开2009年第一次临时股东大会，具体公告详见2009年2月14日刊登在《上海证券报》和巨潮资讯网上《湖南嘉瑞新材料集团股份有限公司关于召开2009年第一次临时股东大会的通知》。

2009年2月18日，本公司收到第一大股东 [illegible] 提交的《关于 [illegible]》的议案，[illegible] 提交本公司2009年第一次临时股东大会审议。

本公司2009年第一次临时股东大会除增加上述一项议案的变化外，股东大会的召开时间、审议地点、股权登记日等相关事项无变化。

特此公告。

湖南嘉瑞新材料集团股份有限公司董事会
2009年2月18日

易方达基金管理有限公司
关于旗下部分基金获配
天马股份（002122）非公开
发行A股的公告

易方达基金管理有限公司（以下简称"本公司"）所管理的易方达科讯股票型证券投资基金、易方达价值成长混合型证券投资基金、易方达价值精选股票型证券投资基金参加了浙江天马轴承股份有限公司非公开发行A股。

浙江天马轴承股份有限公司已于2009年2月17日发布《浙江天马轴承股份有限公司非公开发行股票发行情况暨股份变动公告》，公布了本次非公开发行结果。

根据中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关规定，本公司现将易方达科讯股票型证券投资基金、易方达价值成长混合型证券投资基金和易方达价值精选股票型证券投资基金获配浙江天马轴承股份有限公司非公开发行A股情况披露如下：

基金名称	获配数量（股）	总成本（元）	总成本占基金资产净值比例	账面价值（元）	账面价值占基金资产净值比例	锁定期
易方达科讯股票型证券投资基金	892,079	41,927,713.00	0.56%	41,990,158.53	0.57%	12个月
易方达价值成长混合型证券投资基金	849,436	39,923,492.00	0.21%	39,982,952.52	0.21%	12个月
易方达价值精选股票型证券投资基金	600,000	28,200,000.00	0.35%	28,242,000.00	0.35%	12个月

注：基金资产净值、账面价值为2009年2月17日数据。

特此公告。

易方达基金管理有限公司
2009年2月19日

易方达基金管理有限公司关于
增加易方达行业领先企业股票型
证券投资基金代销机构的公告

根据易方达基金管理有限公司（以下简称"本公司"）与招商银行股份有限公司（以下简称"招商银行"）、中国光大银行股份有限公司（以下简称"中国光大银行"）和上海银行股份有限公司（以下简称"上海银行"）签署的代销协议，自2009年2月23日起，本公司将增加招商银行、中国光大银行和上海银行代理易方达行业领先企业股票型证券投资基金（以下简称"本基金"）的销售业务。

1. 招商银行
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：秦晓
联系人：万丽
电话：（0755）83198888
传真：（0755）83195047
客户服务电话：95555
网址：www.cmbchina.com

招商银行在以下主要城市的营业网点对投资者办理本基金的开户和认购等业务：深圳、上海、武汉、北京、沈阳、广州、成都、兰州、西安、南京、无锡、常州、苏州、重庆、大连、杭州、宁波、温州、绍兴、南昌、长沙、福州、泉州、青岛、济南、烟台、乌鲁木齐、昆明、合肥、厦门、哈尔滨、天津、东莞、佛山、[illegible]等。

2. 中国光大银行
注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人：唐双宁
联系人：李伟
电话：010–68098778
传真：010–68560661
客户服务电话：95595（全国）
网址：www.cebbank.com

中国光大银行在以下主要城市的营业网点对投资者办理本基金的开户和认购等业务：

北京、哈尔滨、深圳、上海、青岛、大连、长春、重庆、广州、昆明、武汉、烟台、合肥、厦门、福州、成都、苏州、沈阳、宁波、南京、太原、天津、郑州、杭州、济南、西安、长沙、南宁、石家庄、柳州、[illegible]等。

3. 上海银行
注册地址：上海市浦东新区银城中路168号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人：陈辛
联系人：张萍
电话：021–68475888
传真：021–68476111
开放式基金咨询电话：021–962888
开放式基金业务传真：021–68476111
网址：www.bankofshanghai.com

上海银行在以下主要城市的营业网点对投资者办理本基金的开户和认购等业务：
上海、宁波、南京、杭州、天津、成都。

4. 易方达基金管理有限公司
客户服务电话：4008818088
网址：www.efunds.com.cn

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

易方达基金管理有限公司
2009年2月19日