泰达宏利货币市场基金2019年半年度报告

2019-06-30

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2019-08-24

目录全部展开 目录全部收拢

- 重要提示
- 基金简介
  - 基金基本情况
  - 基金产品说明
  - 基金管理人和基金托管人
  - 信息披露方式
  - 其他相关资料
- 主要财务指标和基金净值表现
  - 主要会计数据和财务指标
  - 基金净值表现
    - 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
    - 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
- 管理人报告
  - 基金管理人及基金经理情况
    - 基金管理人及其管理基金的经验
    - 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介
  - 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
  - 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
    - 公平交易制度的执

重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司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。本半年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

项目	数值	
基金名称	泰达宏利货币市场基金	
基金简称	泰达宏利货币	
场内简称		
基金主代码	162206	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005-11-10	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额		2,117,357,925.98
基金合同存续期	不定期	
下属2级基金的基金简称	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
下属2级基金的场内简称		
下属2级基金的交易代码	162206	000700
报告期末下属2级基金的份额总额	493,305,122.67	1,624,052,803.31

基金产品说明

投资目标	在确保本金安全性和基金财产流动性的基础上，力争为投资者获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上，实施稳健的投资风格和谨慎的交易操作。以价值分析为基础，数量分析为支持，采用自上而下确定投资策略和自下而上个券选择的程序，运用供求分析、久期偏离、收益率曲线配置和类属配置等积极投资策略,实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	税后一年期银行定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期收益率和预期风险均低于股票型、混合型和债券型基金。
下属分级基金的风险收益特征	

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		泰达宏利基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	聂志刚	贺倩
	联系电话	010－66577678	010-66060069
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-698-8888	95599
传真		010－66577666	010-68121816
注册地址		北京市西城区金融大街7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		北京市西城区金融大街7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		弓劲梅	周慕冰

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	http://www.mfcteda.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰达宏利基金管理有限公司	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期	报告期(2019-01-01 至 2019-06-30)		
	泰达宏利货币	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
本期已实现收益		7,493,178.39	43,061,115.40
本期利润		7,493,178.39	43,061,115.40
加权平均基金份额本期利润			
本期加权平均净值利润率	-%	-%	-%
本期基金份额净值增长率	-%	-%	-%
本期净值收益率	-%	1.4869 %	1.6077 %
报告期末	报告期末(2019-06-30)		
	泰达宏利货币	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
期末可供分配利润			
期末可供分配基金份额利润			
期末基金资产净值		493,305,122.67	1,624,052,803.31
期末基金份额净值		1.0000	1.0000
报告期末	报告期末(2019-06-30)		
	泰达宏利货币	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
基金份额累计净值增长率	-%	-%	-%
累计净值收益率	-%	51.7740 %	19.5741 %

注：

注：1.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。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；

2.所述基金业绩指标不包括基金份额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；

3.本基金收益分配按日结转份额。

基金净值表现

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A

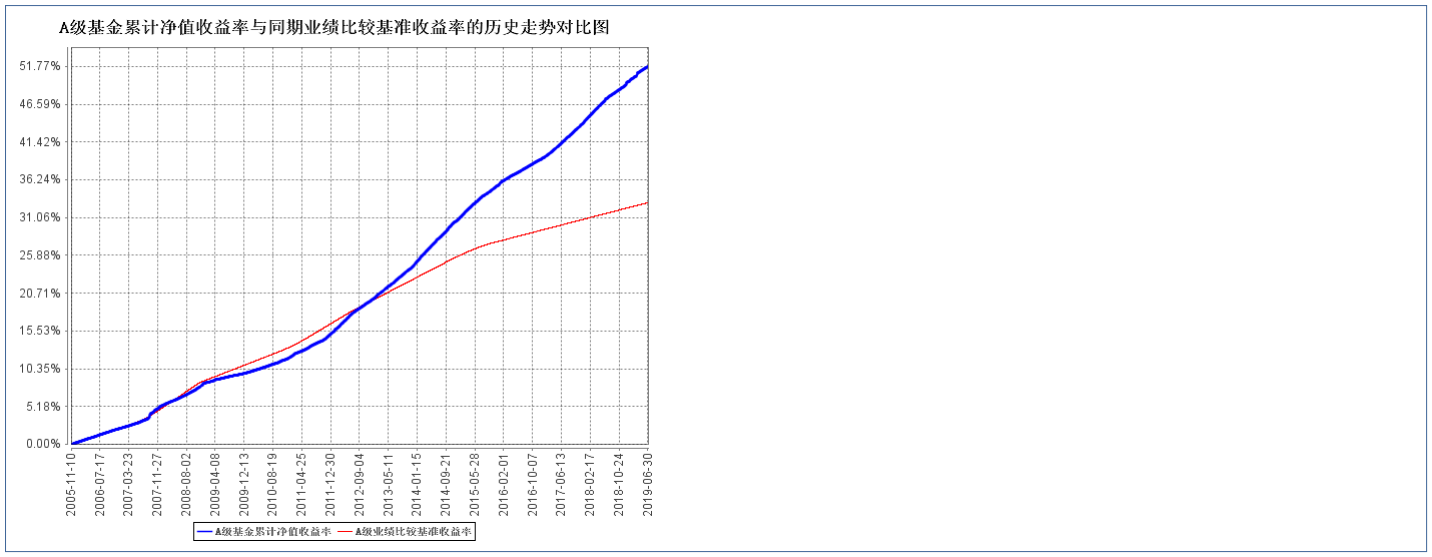
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2134 %	0.0024 %	0.1233 %	0.0000 %	0.0901 %	0.0024 %
过去三个月	0.6295 %	0.0031 %	0.3740 %	0.0000 %	0.2555 %	0.0031 %
过去六个月	1.4869 %	0.0100 %	0.7438 %	0.0000 %	0.7431 %	0.0100 %
过去一年	3.0475 %	0.0103 %	1.5000 %	0.0000 %	1.5475 %	0.0103 %
过去三年	10.3978 %	0.0069 %	4.5000 %	0.0000 %	5.8978 %	0.0069 %
自基金合同生效起至今	51.7740 %	0.0070 %	33.1102 %	0.0022 %	18.6638 %	0.0048 %

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B

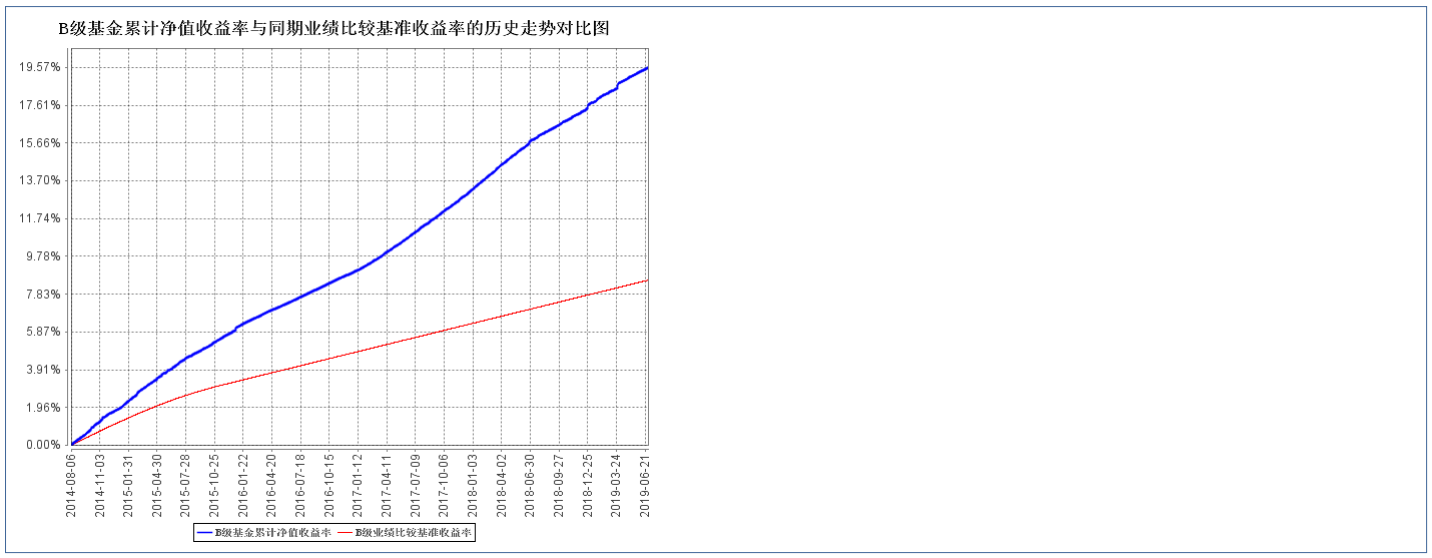
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2332 %	0.0024 %	0.1233 %	0.0000 %	0.1099 %	0.0024 %
过去三个月	0.6897 %	0.0031 %	0.3740 %	0.0000 %	0.3157 %	0.0031 %
过去六个月	1.6077 %	0.0100 %	0.7438 %	0.0000 %	0.8639 %	0.0100 %
过去一年	3.2951 %	0.0103 %	1.5000 %	0.0000 %	1.7951 %	0.0103 %
过去三年	11.1946 %	0.0069 %	4.5000 %	0.0000 %	6.6946 %	0.0069 %
自基金合同生效起至今	19.5741 %	0.0073 %	8.5534 %	0.0013 %	11.0207 %	0.0060 %

注：注：1、本基金收益分配原则自2017年5月11日起变更为“每日分配、按日支付”。
2、本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。
3、本基金A类份额成立于2005年11月10日，B类份额成立于2014年8月6日。

自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较A



自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较B



注：注：本基金A类份额成立于2005年11月10日，B类份额成立于2014年8月6日。本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

基金管理人及基金经理情况

基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于2002年6月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：天津市泰达国际控股（集团）有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有限公司：49%。
目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利宏达混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利交利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利金利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利泽利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、泰达宏利年年添利定期开放债券型证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。
本公司采用团队投资方式，即通过整个投资团队全体人员的共同努力，力求实现基金财产的持续增值。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁宇佳	固定收益部总经理；基金经理	2015-03-26	-	11	中央财经大学理学学士；2008年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、基金经理助理，现任固定收益部总经理兼基金经理；具备11年基金从业经验，11年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
王靖	本基金基金经理助理，固定收益部副总经理	2017-03-08	2019-03-29	12	澳大利亚国立大学财务管理硕士；2007年11月至2010年3月，任职于华夏基金管理有限公司基金运作部，担任基金会计；2010年3月至2012年3月，任职于华融证券股份有限公司资产管理部，担任投资经理；2012年3月至2014年4月，任职于国盛证券有限责任公司资产管理总部，担任投资经理；2014年5月至2016年6月，任职于北信瑞丰基金管理有限公司，担任固定收益部总监兼基金经理；2016年6月至2016年10月，任职安邦基金管理有限公司（筹），担任固定收益投资部副总经理；2016年11月加入泰达宏利基金管理有限公司，现任固定收益部副总经理兼基金经理；具备12年证券从业经验，具有基金从业资格。
李祥源	本基金经理助理	2019-06-19	-	4	澳洲国立大学金融管理硕士，2012年9月至2013年3月任职于普华永道咨询（深圳）有限公司北京分公司，担任税务部助理分析师；2013年4月至2015年5 月任职于联合资信评估有限公司，担任工商企业部分析师；2015年加入泰达宏利基金管理有限公司，曾任助理研究员、研究员，现任基金经理助理，具备4年基金从业经验，具有基金从业资格。

注：注：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。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；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，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的5%。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，全球经济明显放缓，悲观预期继续抬升，主要经济体货币政策已趋向宽松，美国经济已现疲弱态势，美联储下半年降息概率增加，加之贸易摩擦背景，全球避险情绪抬头。国内方面，一季度金融数据见底企稳，融资环境出现改善，但是二季度受到包商银行被托管等事件影响，信用扩张的趋势有一定程度的放缓。受地方专项债可以用作合格重大基建项目资本金政策的影响，基建投资仍然起到较为关键的托底作用，但土地成交数据不足以支撑地产投资维持在合意水平，低盈利也限制了实体经济进行固定资产投资的意愿，一季度中美贸易谈判曾经显示似乎进入佳境，但二季度出现重大转折，影响较为深远。

债券市场在一月走完了上半年最大的行情，4月经历整整一个月的下跌，5月6月收复部分失地，总体曲线仍然稍显陡峭。5月底爆发包商银行事件，债券市场迅速发酵，造成部分金融机构短期流动性紧张，虽然事后央行表示维稳意愿，但同业负债的滚动和市场信心的恢复仍面临考验，信用利差明显走阔。

报告期内，我们仍认为央行的货币政策不会短时间内转向，低利率大概率是长期逻辑，二季度末央行对资金面的呵护意愿尤为明显，但出于流动性考量和防范黑天鹅事件，我们投资风格更加谨慎，在满足监管指标的前提下，我们更侧重对银行存单和回购的配置，增加组合流动性。

报告期内基金的业绩表现

本报告期泰达宏利货币A的基金份额净值收益率为1.4869%，本报告期泰达宏利货币B的基金份额净值收益率为1.6077%，同期业绩比较基准收益率为0.7438%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为外部环境的不确定性仍在，国内基建的一枝独秀难以带动经济的全面企稳，资金面宽松预期仍在，但在目前绝对收益率较低的位置上，投资上仍然以谨慎为主，以高流动性为投资首要目的。

管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管基金运营的副总经理担任主任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的利润分配方式为按日结转份额。根据相关法律法规及基金合同，本基金每日采用红利再投资的方式将各类基金份额的已实现收益全额分配给基金份额持有人。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

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。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管泰达宏利货币市场基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《泰达宏利货币市场基金金基金合同》、《泰达宏利货币市场基金托管协议》的约定，对泰达宏利货币市场基金管理人—泰达宏利基金管理有限公司2019年1月1日至2019年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，泰达宏利基金管理有限公司在泰达宏利货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、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问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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。

托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，泰达宏利基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的泰达宏利货币市场基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

资产负债表

会计主体：泰达宏利货币市场基金
报告截止日：2019-06-30

单位：人民币元

资产	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
资产：		
银行存款	9,247,374.68	606,533,351.23
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,810,315,067.70	1,506,176,223.74
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,810,315,067.70	1,506,176,223.74
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	650,241,695.37	1,055,522,063.28
应收证券清算款	-	-
应收利息	5,851,291.51	22,330,674.51
应收股利	-	-
应收申购款	43,665,420.47	186,823.73
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,519,320,849.73	3,190,749,136.49
负债和所有者权益	**本期末 2019-06-30**	**上年度末 2018-12-31**
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	399,799,120.10	521,618,377.57
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	690,732.46	1,384,710.21
应付托管费	209,312.88	419,609.13
应付销售服务费	125,934.70	115,452.39
应付交易费用	94,400.99	121,753.73
应交税费	143,131.71	244,630.34
应付利息	71,374.48	384,628.08
应付利润	682,202.30	880,693.80
递延所得税负债	-	-
其他负债	146,714.13	446,105.00
负债合计	401,962,923.75	525,615,960.25
所有者权益：	-	-
实收基金	2,117,357,925.98	2,665,133,176.24

未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,117,357,925.98	2,665,133,176.24
负债和所有者权益总计	2,519,320,849.73	3,190,749,136.49

注：注:报告截止日2019年6月30日，泰达宏利货币A基金份额净值1.0000元，基金份额总额493,305,122.67份；泰达宏利货币B基金份额净值1.0000元，基金份额总额1,624,052,803.31份。泰达宏利货币份额总额合计为2,117,357,925.98份。

利润表

会计主体：泰达宏利货币市场基金
本报告期：2019-01-01至2019-06-30

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
一、收入	61,016,170.84	168,566,530.63
1.利息收入	64,523,166.03	165,672,440.82
其中：存款利息收入	8,237,180.90	64,238,134.15
债券利息收入	39,930,945.13	80,746,707.65
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	16,355,040.00	20,687,599.02
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-3,506,995.19	2,894,089.81
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,506,995.19	2,894,089.81
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
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）	-	-
减：二、费用	10,461,877.05	21,558,015.02
1. 管理人报酬	5,802,017.43	11,271,562.76
2. 托管费	1,758,187.06	3,415,625.06
3. 销售服务费	803,453.32	857,603.93
4. 交易费用	342.50	799.78
5. 利息支出	1,852,038.06	5,631,060.85
其中：卖出回购金融资产支出	1,852,038.06	5,631,060.85
6. 税金及附加	52,486.35	104,768.73
7. 其他费用	193,352.33	276,593.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	50,554,293.79	147,008,515.61
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	50,554,293.79	147,008,515.61

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利货币市场基金
本报告期：2019-01-01至2019-06-30

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30		
	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）	2,665,133,176.24	-	2,665,133,176.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	50,554,293.79	50,554,293.79
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）	-547,775,250.26	-	-547,775,250.26
其中：1.基金申购款	14,631,703,771.29	-	14,631,703,771.29
2.基金赎回款	-15,179,479,021.55	-	-15,179,479,021.55
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）	-	-50,554,293.79	-50,554,293.79
五、期末所有者权益（基金净值）	2,117,357,925.98	-	2,117,357,925.98

项目	上年度可比期间 -至-		
	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）	6,783,848,618.99	-	6,783,848,618.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	147,008,515.61	147,008,515.61
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）	-3,153,072,912.20	-	-3,153,072,912.20
其中：1.基金申购款	24,351,306,981.81	-	24,351,306,981.81
2.基金赎回款	-27,504,379,894.01	-	-27,504,379,894.01
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）	-	-147,008,515.61	-147,008,515.61
五、期末所有者权益（基金净值）	3,630,775,706.79	-	3,630,775,706.79

本报告第6.1页至第6.4页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘建　　主管会计工作负责人：傅国庆　　会计机构负责人：王泉

注：此处为PDF文件中的章节数或者页数。

报表附注

基金基本情况

泰达宏利货币市场基金(以下简称“本基金”，原湘财荷银货币市场基金，后更名为泰达荷银货币市场基金)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[2005]第161号《关于同意湘财荷银货币市场基金设立的批复》核准，由湘财荷银基金管理有限公司(于2006年4月27日更名为泰达荷银基金管理有限公司，于2010年3月9日更名为泰达宏利基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《湘财荷银货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集4,642,951,338.78元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第164号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《湘财荷银货币市场基金基金合同》于2005年11月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,643,264,492.55份基金份额，其中认购资金利息折合313,153.77份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。
经中国证监会同意，本基金于2006年6月6日更名为泰达荷银货币市场基金。根据本基金的基金管理人2010年3月17日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更公司旗下公募基金名称的公告》，本基金自公告发布之日起更名为泰达宏利货币市场基金。
根据《关于泰达宏利货币市场基金实施份额分类并修改基金合同、招募说明书和托管协议的公告》，自2014年8月6日起，本基金根据投资者持有的基金份额数量级别将基金份额分为A类和B类，不同级别的基金份额适用不同费率的销售服务费；并根据投资者基金交易账户所持有份额数量是否不低于300万份进行不同级别基金份额的判断和处理。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》和《泰达宏利货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于货币市场工具，主要包括现金、期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据和同业存单，剩余期限在397天内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，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。本基金的业绩比较基准为：税后一年期银行定期存款利率。

会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利货币市场基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。
本财务报表以持续经营为基础编制。

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年度上半年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2019年6月30日的财务状况以及2019年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

重要会计政策和会计估计

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。

会计年度

-

记账本位币

-

金融资产和金融负债的分类

-

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

金融资产和金融负债的估值原则

-

金融资产和金融负债的抵销

-

实收基金

-

损益平准金

-

收入/(损失)的确认和计量

-

费用的确认和计量

-

基金的收益分配政策

-

其他重要的会计政策和会计估计

-

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
活期存款	9,247,374.68	-
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	9,247,374.68	606,533,351.23

交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019-06-30 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	1,810,315,067.70	1,815,658,000.00	5,342,932.30	0.2523
	合计	1,810,315,067.70	1,815,658,000.00	5,342,932.30	0.2523
资产支持证券		-	-	-	-
合计		1,810,315,067.70	1,815,658,000.00	5,342,932.30	0.2523

项目		上年度末 2018-12-31 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	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
合计		-	-	-	-

注：注：

1. 偏离金额＝影子定价－摊余成本；
2. 偏离度＝偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30 合同/名义金额	公允价值 资产	负债	备注
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

项目	上年度末 2018-12-31 合同/名义金额	公允价值 资产	负债	备注
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：本基金本报告期末无衍生金融资产和负债。

买入返售金融资产

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 2019-06-30	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	650,241,695.37	-
合计	650,241,695.37	-
项目	上年度末 2018-12-31	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量（张）	估值总额	其中：已出售或再质押总额
项目	上年度末 2018-12-31						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量（张）	估值总额	其中：已出售或再质押总额

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
应收活期存款利息	109,038.98	-
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	-	-
应收债券利息	5,370,303.19	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	371,949.34	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	5,851,291.51	22,330,674.51

其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	94,400.99	-
合计	94,400.99	121,753.73

其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付银行手续费	2,020.00	-
预提费用	144,694.13	-
合计	146,714.13	446,105.00

实收基金

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30			
	泰达宏利货币A		泰达宏利货币B	
	基金份额（份）	账面金额	基金份额（份）	账面金额
上年度末	385,673,895.58	385,673,895.58	2,279,459,280.66	2,279,459,280.66
本期申购	1,439,008,215.05	1,439,008,215.05	13,192,695,556.24	13,192,695,556.24
本期赎回（以“-”号填列）	-1,331,376,987.96	-1,331,376,987.96	-13,848,102,033.59	-13,848,102,033.59
本期末	493,305,122.67	493,305,122.67	1,624,052,803.31	1,624,052,803.31

注：注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

未分配利润

泰达宏利货币A

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	7,493,178.39	-	7,493,178.39
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	-7,493,178.39	-	-7,493,178.39
本期末	-	-	-

泰达宏利货币B

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	43,061,115.40	-	43,061,115.40
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	-43,061,115.40	-	-43,061,115.40
本期末	-	-	-

存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
活期存款利息收入	176,374.89	-
定期存款利息收入	8,060,806.01	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	8,237,180.90	64,238,134.15

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出股票成交总额	-	-
减：卖出股票成本总额	-	-
买卖股票差价收入	-	-

注：本基金本报告期内无买卖股票差价收入。

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,506,995.19	-
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	-3,506,995.19	2,894,089.81

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,597,096,992.48	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,509,160,628.04	-
减：应收利息总额	91,443,359.63	-
买卖债券差价收入	-3,506,995.19	-

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
赎回基金份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回债券成本总额	-	-
减：赎回债券应收利息总额	-	-
赎回差价收入	-	-

注：本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
申购基金份额对价总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购债券成本总额	-	-
减：申购债券应收利息总额	-	-
申购差价收入	-	-

注：本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出资产支持证券成交总额	-	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-	-
减：应收利息总额	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

贵金属投资收益

贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出贵金属成交总额	-	-
减：卖出贵金属成本总额	-	-
减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额	-	-
买卖贵金属差价收入	-	-

注：本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
赎回贵金属份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回贵金属成本总额	-	-
赎回差价收入	-	-

注：本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
申购贵金属份额总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购贵金属成本总额	-	-
申购差价收入	-	-

注：本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出权证成交总额	-	-
减：卖出权证成本总额	-	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-	-
买卖权证差价收入	-	-

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间收益金额 -至-
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-	-

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
股票投资产生的股利收益	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期内无股利收益。

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
1.交易性金融资产	-	-
——股票投资	-	-
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期内无公允价值变动收益。

其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
基金赎回费收入	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期内无其他收入。

交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	342.50	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	342.50	799.78

其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
审计费用	77,011.88	-
信息披露费	58,828.41	-
其他	600.00	-
账户维护费	17,853.84	-
银行费用	39,058.20	-
合计	193,352.33	276,593.91

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

本基金本报告期无或有事项。

资产负债表日后事项

本基金本报告期无资产负债表日后事项。

关联方关系

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

本报告期没有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
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

注：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。

权证交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

注：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。

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
关联方名称	上年度可比期间 -至-			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

注：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。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
当期发生的基金应支付的管理费	5,802,017.43	11,271,562.76
其中：支付销售机构的客户维护费	1,049,989.86	761,294.63

注：注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.33% / 当年天数。

基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
当期发生的基金应支付的托管费	1,758,187.06	3,415,625.06

注：注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

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 2019-01-01至2019-06-30 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B	合计
泰达宏利基金管理有限公司	19,692.34	82,219.53	101,911.87
中国农业银行	36,645.39	1,177.35	37,822.74
合计	56,337.73	83,396.88	139,734.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 -至- 当期应支付的销售服务费		
	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B	合计
泰达宏利基金管理有限公司	25,371.58	272,067.43	297,439.01
中国农业银行	27,259.60	721.75	27,981.35
合计	52,631.18	272,789.18	325,420.36

注：注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。其计算公式为：日销售服务费＝前一日基金资产净值×对应级别约定年费率/ 当年天数。

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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30					
	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
中国农业银行	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 -至-					
	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
中国农业银行	-	-	-	-	480,000,000.00	35,110.14

各关联方投资本基金的情况

报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
份额级别	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
基金合同生效日（2005-11-10）持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-%	-%	-%	-%

注：本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

项目	泰达宏利货币A			
	本期末 2019-06-30		上年度末 2018-12-31	
	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
中国农业银行涟源市支行	332.52	0.0001 %	327.58	0.0001 %
项目	泰达宏利货币B			
	本期末 2019-06-30		上年度末 2018-12-31	
	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

注：本基金管理人之外的其他关联方投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

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 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	9,247,374.68	176,374.89	13,676,702.58	115,199.12

注：注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按约定利率计息。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
上年度可比期间 -至-					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

利润分配情况

利润分配情况——货币市场基金泰达宏利货币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
7,460,484.01	-	32,694.38	7,493,178.39-	

利润分配情况——货币市场基金泰达宏利货币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
43,292,301.28	-	-231,185.88	43,061,115.40-	

期末（2019-06-30）本基金持有的流通受限证券

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

注：本基金本报告期末无因认购新股或增发而于期末持有的流通受限证券。

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额399,799,120.10元，是以如下债券作为抵押:

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
199918	19贴现国债18	2019-07-01	99.73	200,000	19,946,000.00
071900038	19国信证券CP005	2019-07-01	99.87	830,000	82,892,100.00
140358	14进出58	2019-07-01	100.25	600,000	60,150,000.00
071900037	19光大证券CP003BC	2019-07-01	99.90	1,060,000	105,894,000.00
071900039	19天风证券CP001	2019-07-01	99.80	1,000,000	99,800,000.00
111814154	18江苏银行CD154	2019-07-01	99.46	220,000	21,881,200.00
180312	18进出12	2019-07-01	99.92	200,000	19,984,000.00
合计				4,110,000	410,547,300.00

交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

金融工具风险及管理

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金的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“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。
本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。
本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。
本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在A-1级以下或长期信用评级在AA+级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净值产的10%。
本基金债券投资、资产支持证券投资和同业存单的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
A-1	419,518,872.81	219,866,129.73
A-1以下	-	-
未评级	139,129,879.56	550,405,195.26
合计	558,648,752.37	770,271,324.99

注： 注：以上未评级的债券投资中包括超短期融资券等。

按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注： 本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,131,572,580.84	596,075,512.06
合计	1,131,572,580.84	596,075,512.06

按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	120,093,734.49	139,829,386.69
合计	120,093,734.49	139,829,386.69

注：注：以上未评级的债券投资中包括国债 、政策性金融债及央行票据等。

按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。
针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。
于2019年6月30日，除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2019-06-30		合计
资产		
资产总计		-
负债		
负债总计	-	
流动性净额		-
上年度末 2018-12-31		**合计**
资产		
资产总计		-
负债		
负债总计	-	
流动性净额		-

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在基金运作过程中严格按照《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》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。
一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过240天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过60天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%。
本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%。
本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的10%。
同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。
综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。
本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019-06-30	6个月以内	6个月-1年	不计息	合计
资产				
银行存款	9,247,374.68	-	-	9,247,374.68
交易性金融资产	1,712,950,479.03	97,364,588.67	-	1,810,315,067.70
买入返售金融资产	650,241,695.37	-	-	650,241,695.37
应收利息	-	-	5,851,291.51	5,851,291.51
应收申购款	-	-	43,665,420.47	43,665,420.47
资产总计	2,372,439,549.08	97,364,588.67	49,516,711.98	2,519,320,849.73
负债				
卖出回购金融资产款	399,799,120.10	-	-	399,799,120.10
应付管理人报酬	-	-	690,732.46	690,732.46
应付托管费	-	-	209,312.88	209,312.88
应付销售服务费	-	-	125,934.70	125,934.70
应付交易费用	-	-	94,400.99	94,400.99
应付利息	-	-	71,374.48	71,374.48
应交税费	-	-	143,131.71	143,131.71
应付利润	-	-	682,202.30	682,202.30
其他负债	-	-	146,714.13	146,714.13
负债总计	399,799,120.10	-	2,163,803.65	401,962,923.75
利率敏感度缺口	1,972,640,428.98	97,364,588.67	47,352,908.33	2,117,357,925.98
上年度末 2018-12-31	**6个月以内**	**6个月-1年**	**不计息**	**合计**
资产				
银行存款	606,533,351.23	-	-	606,533,351.23
交易性金融资产	1,486,335,009.80	19,841,213.94	-	1,506,176,223.74
买入返售金融资产	1,055,522,063.28	-	-	1,055,522,063.28
应收利息	-	-	22,330,674.51	22,330,674.51
应收申购款	-	-	186,823.73	186,823.73
其他资产	-	-	-	-
资产总计	3,148,390,424.31	19,841,213.94	22,517,498.24	3,190,749,136.49
负债				
卖出回购金融资产款	521,618,377.57	-	-	521,618,377.57
应付管理人报酬	-	-	1,384,710.21	1,384,710.21
应付托管费	-	-	419,609.13	419,609.13
应付销售服务费	-	-	115,452.39	115,452.39
应付交易费用	-	-	121,753.73	121,753.73
应付利息	-	-	384,628.08	384,628.08
应交税费	-	-	244,630.34	244,630.34
应付利润	-	-	880,693.80	880,693.80
其他负债	-	-	446,105.00	446,105.00
负债总计	521,618,377.57	-	3,997,582.68	525,615,960.25
利率敏感度缺口	2,626,772,046.74	19,841,213.94	18,519,915.56	2,665,133,176.24

注：注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

利率风险的敏感性分析

假设	-		
		对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析	相关风险变量的变动	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31

注：截止2019年6月30日，在影子定价机制有效的前提下，若市场利率变动25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会产生重大变动(2018年12月31日：同)。

外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

项目	上期末 2018-06-30			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

外汇风险的敏感性分析

假设	-		
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 2019-06-30	上年度末 2018-12-31

其他价格风险

其他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，因此无重大其他价格风险。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30		上年度末 2018-12-31	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
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 2019-06-30	上年度末 2018-12-31

采用风险价值法管理风险

-

假设	-		
	-		
分析	风险价值（金额单位：人民币元）	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

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	1,810,315,067.70	71.86
	其中：债券	1,810,315,067.70	71.86
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	650,241,695.37	25.81
	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	9,247,374.68	0.37
4	其他各项资产	49,516,711.98	1.97
5	合计	2,519,320,849.73	100.00

债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金总资产的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	5.71
	其中：买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	399,799,120.10	18.88
	其中：买断式回购融资	-	-

注：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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2019-02-27	24.47	大额赎回	2019年3月1日调整完毕
2	2019-02-28	21.41	大额赎回	2019年3月1日调整完毕

基金投资组合平均剩余期限

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	51
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	75
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：本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过120天的情况。

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	35.86	18.88
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	53.63	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	16.00	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	11.16	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	116.65	18.88

报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未出现超过240天的情况。

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	19,946,836.93	0.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,146,897.56	4.73
	其中：政策性金融债	100,146,897.56	4.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	558,648,752.37	26.38
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,131,572,580.84	53.44
8	其他	-	-
9	合计	1,810,315,067.70	85.50
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	111909154	19浦发银行CD154	2,200,000	218,650,540.32	10.33
2	111811310	18平安银行CD310	2,000,000	199,236,819.12	9.41
3	071900037	19光大证券CP003BC	1,200,000	119,880,447.86	5.66
4	071900053	19招商CP006	1,000,000	99,973,479.37	4.72
5	071900038	19国信证券CP005	1,000,000	99,865,549.76	4.72
6	071900039	19天风证券CP001	1,000,000	99,799,395.82	4.71
7	111996619	19宁波银行CD076	1,000,000	99,758,555.40	4.71
8	111809344	18浦发银行CD344	1,000,000	99,731,518.72	4.71
9	111991906	19厦门国际银行CD009	1,000,000	99,496,305.56	4.70
10	011900752	19大同煤矿SCP008	1,000,000	99,199,243.26	4.69

“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	27
报告期内偏离度的最高值	0.5208 %
报告期内偏离度的最低值	0.0847 %
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2212 %

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期

注：本基金本报告期内负偏离度的绝对值未出现达到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

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
1	2019-03-28	0.005208	近期市场收益率下行，致使本基金偏离度上升	2019年3月29日调整完毕

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

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，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

本基金本报告期内投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,851,291.51
4	应收申购款	43,665,420.47
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	49,516,711.98

投资组合报告附注的其他文字描述部分

1. 由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
2. 报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

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
泰达宏利货币A	49,151	10,036.52	16,704,582.16	3.39 %	476,600,540.51	96.61 %
泰达宏利货币B	57	28,492,154.44	1,515,758,688.18	93.33 %	108,294,115.13	6.67 %
合计	49,208	43,028.73	1,532,463,270.34	72.38 %	584,894,655.64	27.62 %

注：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）。

期末上市基金前十名持有人A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例

期末上市基金前十名持有人B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例

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）	占上市总份额比例
1	银行类机构	300,972,644.25	14.21 %
2	银行类机构	200,750,936.98	9.48 %
3	其他类机构	110,582,355.21	5.22 %
4	银行类机构	100,638,042.00	4.75 %
5	其他类机构	100,284,142.88	4.74 %
6	保险类机构	94,946,667.01	4.48 %
7	其他类机构	70,517,404.88	3.33 %
8	保险类机构	61,156,110.03	2.89 %
9	保险类机构	56,559,972.41	2.67 %
10	其他类机构	54,090,293.64	2.55 %

期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

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	泰达宏利货币A	381,933.17	0.0774 %
	泰达宏利货币B	0.00	0.0000 %
	合计	381,933.17	0.0180 %

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	泰达宏利货币A	0~10
	泰达宏利货币B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利货币A	0~10
	泰达宏利货币B	0
	合计	0~10

发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-%	-	-%	-
基金管理人高级管理人员	-	-%	-	-%	-
基金经理等人员	-	-%	-	-%	-
基金管理人股东	-	-%	-	-%	-
其他	-	-%	-	-%	-
合计	-	-%	-	-%	-

开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利货币	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
基金合同生效日（2005-11-10）基金份额总额	-	4,643,264,492.55	
本报告期期初基金份额总额	-	385,673,895.58	2,279,459,280.66
本报告期期间总申购份额	-	1,439,008,215.05	13,192,695,556.24
本报告期期间基金总赎回份额	-	1,331,376,987.96	13,848,102,033.59
本报告期期末基金份额总额	2,117,357,925.98	493,305,122.67	1,624,052,803.31

注：注：泰达宏利货币B基金成立于2014年8月6日。

基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

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

1、本公司于2019年1月19日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，王彦杰先生不再担任公司副总经理。
2、2019年1月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。
3、2019年4月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1.本报告期内，中国证券监督管理委员会北京监管局对我司进行了常规全面现场检查，就公司未能建立完善的内控监控体系，提出了整改意见并下达了行政监管措施函，公司对此高度重视，立即制定整改计划和整改方案，认真进行整改，排除业务中存在的风险隐患，逐一落实各项整改要求，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力。公司已按照要求于2019年4月完成整改工作，并通过了中国证券监督管理委员会北京监管局的检查验收。
2.本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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		基金交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		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	成交金额	占当期基金成交总额的比例	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	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银国际	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
渤海证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-

注：注：（一）本基金本报告期未新增、撤销交易单元；
（二） 交易单元选择的标准和程序
基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：
（1）经营规范，有较完备的内控制度；
（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要；
（3）能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。 本基金本报告期未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

偏离度绝对值超过0.5%的情况

项目	发生日期	偏离度	法定披露报刊	法定披露日期
报告期内偏离度绝对值在0.5%（含）以上	-	-	-	-

其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期

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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

影响投资者决策的其他重要信息

-

备查文件目录

1、中国证监会批准基金募集的文件；
2、基金合同；
3、托管协议；
4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
5、基金托管人业务资格批件、营业执照；
6、中国证监会要求的其他文件。

存放地点

基金管理人和基金托管人的住所

查阅方式

基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《证券日报》）或登录本基金管理人互联网网址（http://www.mfcteda.com）查阅。
投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达宏利基金管理有限公司：客户服务中心电话：400-698-8888（免长话费）或010-66555662 ，网址：http://www.mfcteda.com。