泰达宏利货币市场基金

【2013】半年度报告摘要

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
送出日期：２０１３年８月２７日

§１ 重要提示

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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）根据本基金合同规定，于2013年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§２基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	泰达宏利货币
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年11月10日
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	421,405,309.05份
基金合同存续期	不定期

2.2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、混合和债券型基金。

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		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	曹楠楠	李芳菲
	联系电话	010-66577728	010-66060069
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95599
传真		010-66577666	010-63201816

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.mfcteda.com
基金半年度报告报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

§３ 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	11,080,872.89
本期利润	11,080,872.89
本期净值收益率	1.8996%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末基金资产净值	421,405,309.05
期末基金份额净值	1.0000

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

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.本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

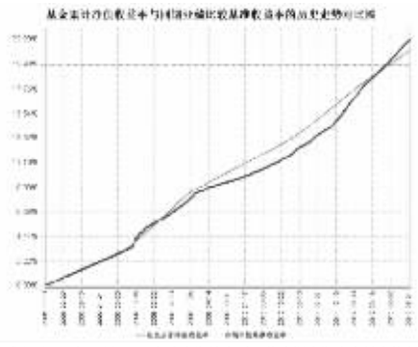
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.2951%	0.0048%	0.2466%	0.0000%	0.0485%	0.0048%
过去三个月	0.9407%	0.0082%	0.7479%	0.0000%	0.1928%	0.0082%
过去六个月	1.8996%	0.0091%	1.4877%	0.0000%	0.4119%	0.0091%
过去一年	3.6945%	0.0071%	3.0034%	0.0001%	0.6911%	0.0070%
过去三年	10.3952%	0.0072%	9.2014%	0.0011%	1.1938%	0.0061%
自基金合同生效起至今	22.1926%	0.0067%	21.2609%	0.0019%	0.9317%	0.0048%

注：1.本基金收益分配按月结转份额。

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。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：本基金成立于2005年11月10日，在建仓期结束时及截止报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§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

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：北方国际信托股份有限公司：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、泰达宏利行业精选基金、泰达宏利风险预算混合型基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型基金、泰达宏利首选企业股票型基金、泰达宏利市值优选股票型基金、泰达宏利集利债券型基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型基金、泰达宏利红利先锋股票型基金、泰达宏利中证财富大盘指数型基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、泰达宏利全球新格局证券投资基金、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略股票型基金、泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金在内的二十只证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
胡振仓	本基金基金经理	2008年8月9日	-	10	硕士学位。2003年7月至2005年4月就职于乌鲁木齐市商业银行，从事债券交易与研究工作，2006年3月至2006年6月就职于国联证券公司，从事债券交易工作；2006年7月至2008年3月就职于益民基金管理有限公司，其中2006年7月至2006年11月任益民货币市场基金基金经理助理，2006年12月至2008年3月任益民货币市场基金基金经理。2008年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司。自2008年8月起至今担任泰达宏利货币市场基金(泰达货币基金)基金经理。10年证券从业经验，7年基金从业经验，具有基金从业资格。

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。

4.2 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。

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，没有发生利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

4.3.2 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。在本报告期内，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。

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

2013年上半年，美国受益于房地产市场持续好转和消费的推动，经济复苏相对比较稳健。市场对缩减QE的预期越来越强烈，6月份美联储会议也释放了类似的信号。国内，经济增长在1季度表现偏弱之后，2季度依然表现不佳。6月份在外管局严查虚假贸易之后，进出口贸易也回归到较弱的真实状况，中国经济增长下台阶基本成为市场普遍共识。

政策上，与世界其他主要大国继续实施宽松政策有所不同，新一届领导集体上台之后，中国的宏观政策发生了一些转变，控风险成为目标之一。5月10日，停发17个月之后，央行重启央票发行。6月，央行并没有像往常一样在银行间市场利率上升较快之时果断出手，更多的只是一再强调银行间总体流动性充裕。

货币市场方面，5月底前，货币市场波动率有所下降，去年底和春节期间央行细心呵护，银行间市场资金状况比较平稳。期间，除2月下旬因为财政缴款等因素叠加，银行间资金较为紧张之外，回购利率维持低位。进入6月份之后，尽管银行体系总体备付金仍处于较高水平，各机构普遍感到资金非常紧张，R007最高到过28%的水平。受资金利率大幅飙升影响，短债收益率大幅跳升200-500bp，大大超出市场的预期。

本基金上半年操作相对积极，增持了较多较长久期的短期融资券和利率债，整体组合剩余期限有所上升。进入5、6月，本基金操作相对谨慎，减持了部分短融和利率债，增加了回购和银行存款，总体组合久期和持债比重有所降低。由于6月开始，短债收益率上行幅度较大，本基金也受到一定冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为1.0000元，本报告期份额净值增长率为1.8996%，同期业绩比较基准增长率为1.4877%。

4.5 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，本届政府对经济增长的目标有所弱化，用好增量、盘活存量和控风险成为近期宏观调控的重点，社会融资总量增速预计将有所放缓，部分金融机构和经济实体面临较为艰难的去杆杠过程。另一方面，外汇占款经历上半年的高增长之后，越来越近的QE退出脚步使得套利资金流出压力较大。总体判断，银行间市场正在面临资金由宽松向偏紧的转变，回购利率水平将有所抬升。季节性、临时性因素对资金面和短债市场的冲击将会比较剧烈。

4.6 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运营的副总经理负责，成员包括督察长、投资总监、基金经理及研究部、交易部、固定收益部、监察稽核部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员，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。本公司参与估值流程各方之间没有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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同约定，本基金于本报告期累计分配收益11,080,872.89元，其中按红利再投资形式于每月中旬集中结转至基金持有人账户9,543,438.51元。

§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

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2013年1月1日至2013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。

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。

5.3 托管人对本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。

§６ 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利货币市场基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产：		
银行存款	711,454.34	60,522,102.17
结算备付金	-	63,636.36
存出保证金	-	-
交易性金融资产	240,249,900.68	180,521,547.14
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	240,249,900.68	180,521,547.14
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	203,500,747.75	100,000,350.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	4,814,504.49	4,130,045.80
应收股利	-	-
应收申购款	1,619,806.39	18,600.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	450,896,413.65	345,256,281.47
负债和所有者权益	**本期末 2013年6月30日**	**上年度末 2012年12月31日**
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	28,214,865.89	32,049,783.97
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	160,754.73	154,032.83
应付托管费	48,713.55	46,676.58
应付销售服务费	121,783.92	116,691.48
应付交易费用	21,480.74	17,617.14
应交税费	51,309.84	51,309.84
应付利息	11,590.17	3,452.19
应付利润	682,087.92	988,218.76
递延所得税负债	-	-
其他负债	178,517.84	69,893.50
负债合计	29,491,104.60	33,497,676.29
所有者权益：		
实收基金	421,405,309.05	311,758,605.18
未分配利润	-	-
所有者权益合计	421,405,309.05	311,758,605.18
负债和所有者权益总计	450,896,413.65	345,256,281.47

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额421,405,309.05份。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利货币市场基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	13,712,216.42	10,607,601.40
1.利息收入	12,053,088.80	8,270,967.49
其中：存款利息收入	797,042.89	1,389,406.42
债券利息收入	6,642,805.55	5,099,073.87
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,613,240.36	1,782,487.20
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	1,659,127.62	2,336,633.91
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,659,127.62	2,336,633.91
资产支持证券投资收益	-	-
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	2,631,343.53	1,689,546.94
1.管理人报酬	986,440.25	656,485.54
2.托管费	298,921.30	198,935.01
3.销售服务费	747,303.33	497,337.54
4.交易费用	-	-
5.利息支出	381,968.49	122,234.29
其中：卖出回购金融资产支出	381,968.49	122,234.29
6.其他费用	216,710.16	214,554.56
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	11,080,872.89	8,918,054.46
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	11,080,872.89	8,918,054.46

6.3 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：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	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)	311,758,605.18	-	311,758,605.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,080,872.89	11,080,872.89
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）	109,646,703.87	-	109,646,703.87
其中：1.基金申购款	2,610,568,750.78	-	2,610,568,750.78
2.基金赎回款	-2,500,922,046.91	-	-2,500,922,046.91
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)	-	-11,080,872.89	-11,080,872.89
五、期末所有者权益(基金净值)	421,405,309.05	-	421,405,309.05
项目	**上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日**		
	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)	87,565,824.24	-	87,565,824.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,918,054.46	8,918,054.46
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）	567,445,491.87	-	567,445,491.87
其中：1.基金申购款	2,818,790,559.29	-	2,818,790,559.29
2.基金赎回款	-2,251,345,067.42	-	-2,251,345,067.42
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)	-	-8,918,054.46	-8,918,054.46
五、期末所有者权益(基金净值)	655,011,316.11	-	655,011,316.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____刘青山_____ _____傅国庆_____ ____王泉____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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《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，本基金的投资范围为现金、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单，剩余期限在397天以内（含397天）的债券，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据和债券回购，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。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于2013年8月27日批准报出。

6.4.2 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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会基金部通知［2010］5号关于发布《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《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》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013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2013年6月30日的财务状况以及2013年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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的说明

本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税［2002］128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税［2004］78号《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b)基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本基金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。

6.4.7.2 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	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易-

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

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。

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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	986,440.25	656,485.54
其中：支付销售机构的客户维护费	259,226.48	172,228.13

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 X 0.33% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	298,921.30	198,935.01

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
泰达宏利基金管理有限公司	81,336.85
中国农业银行股份有限公司	99,856.60
合计	181,193.45
获得销售服务费各关联方名称	**上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日**
	当期发生的基金应支付的销售服务费
泰达宏利基金管理有限公司	44,145.59
中国农业银行股份有限公司	44,864.08
合计	89,009.67

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，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。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日					
	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	50,413,334.93	50,280,356.16	-	-	94,460,000.00	10,770.90
	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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
中国农业银行	-	149,303,359.78	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012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
中国农业银行涟源市支行	269.37	0.00%	264.69	0.00%

6.4.8.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	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	711,454.34	18,840.16	1,528,854.06	25,681.37

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。

6.4.8.6 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参与关联方承销证券。

6.4.8.7 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需作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末2013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28,214,865.89元。是以如下债券作为质押：

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
100230	10国开30	2013年7月1日	99.76	285,000	28,431,600.00
合计				285,000	28,431,600.00

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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。

§７ 投资组合报告

7.1 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	240,249,900.68	53.28
	其中：债券	240,249,900.68	53.28
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	203,500,747.75	45.13
	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	711,454.34	0.16
4	其他各项资产	6,434,310.88	1.43
5	合计	450,896,413.65	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		4.16
	其中：买断式回购融资		-
序号	**项目**	**金额**	**占基金资产净值的比例(%)**
2	报告期末债券回购融资余额	28,214,865.89	6.70
	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

本基金本报告期内未出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	159
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	69

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过180天的情况。

7.3.2 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	50.82	6.70
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	7.16	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	7.16	-
3	60天(含)—90天	11.87	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	9.49	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	26.13	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		105.47	6.70

7.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	120,136,411.89	28.51
	其中：政策性金融债	120,136,411.89	28.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	120,113,488.79	28.50
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	240,249,900.68	57.01
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	30,192,523.82	7.16

注：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。

7.5 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	120228	12国开28	500,000	49,936,733.89	11.85
2	100230	10国开30	300,000	30,192,523.82	7.16
3	041364014	13闽东电力CP001	200,000	20,061,352.28	4.76
4	041359032	13鲁晋王曲CP001	200,000	20,040,948.43	4.76
5	130201	13国开01	200,000	20,007,008.82	4.75
6	041259059	12雏鹰CP002	200,000	20,006,394.29	4.75
7	041351014	13皖国贸CP002	200,000	20,003,980.64	4.75
8	120245	12国开45	200,000	20,000,145.36	4.75
9	041360032	13昆明制药CP001	100,000	10,000,970.91	2.37
10	041358043	13渝粮CP001	100,000	10,000,386.70	2.37

7.6 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	4
报告期内偏离度的最高值	0.2258%
报告期内偏离度的最低值	-0.4130%
报告期内每个交易