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

2018年第二季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月19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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17日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。

本报告期间为2018年4月1日至2018年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利交利债券	
交易代码	005315	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年12月27日	
报告期末基金份额总额	2,407,256,125.96份	
投资目标	在追求基金资产安全的前提下,力争创造高于业绩比较基准的投资收益	
投资策略	1.封闭期投资策略 本基金的固定收益类资产投资将主要采取信用策略,同时辅之以目标久期调整策略、收益率曲线策略、信用利差配置策略等,并且对于资产支持证券等特殊债券品种将采用针对性投资策略 2.开放期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动	
业绩比较基准	中债总指数(全价)收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利交利债券A	泰达宏利交利债券C
下属分级基金的交易代码	005315	005316
报告期末下属分级基金的份额总额	2,407,256,125.96份	-份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)	
	泰达宏利交利债券A	泰达宏利交利债券C
1. 本期已实现收益	21,089,377.86	-
2. 本期利润	36,924,714.94	-
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0153	-
4. 期末基金资产净值	2,478,607,096.25	-
5. 期末基金份额净值	1.0296	-

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.截止至2018年6月30日本基金C份额为零;当C级份额为零时,C级份额净值显示与A及份额净值相同。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰达宏利交利债券A

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
过去三个月	1.51%	0.05%	1.76%	0.15%	-0.25%	-0.10%

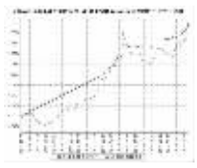
泰达宏利交利债券C

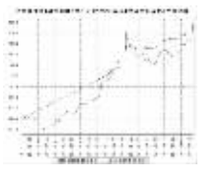
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.51%	0.05%	1.76%	0.15%	-0.25%	-0.10%

注:本基金业绩比较基准:中债总指数(全价)收益率

中债总指数是全样本债券指数,包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券,从总体债券指数中进行抽样选择债券编制而成,或给以流动性调整所编制的债券指数均可称为可复制指数,能客观反映一国或地区或某一市场的债券总体情况。故本基金选取中债总指数(全价)收益率作为业绩比较基准。

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





本基金成立于2017年12月27日,截止报告期末本基金成立不满一年。按基金合同规定,自基金合同生效日起六个月内为建仓期。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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
傅浩	本基金基金经理	2017年12月27日	-	11	华中科技大学理学硕士;2007年7月至2011年8月,任职于东兴证券研究所,担任固定收益研究员;2011年8月至2013年4月,任职于中邮证券有限责任公司,担任投资主办人;2013年5月至2014年4月,任职于民生证券股份有限公司,担任投资经理;2014年5月至2016年11月,任职于中加基金管理有限公司,担任投资经理;2016年11月加入泰达宏利基金管理有限公司,先后担任固定收益部基金经理助理、基金经理等职;具备11年证券投资管理经验,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。 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。

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 公平交易专项说明

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,未发现利益输送、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%, 在本报告期内出未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,中国经济增长保持了稳定,但是贸易战、去杠杆等干扰因素重叠,债券市场因各种因素的交织打乱了下行的步伐,走出了一个震荡盘整的态势。票息交易、杠杆策略成为了2季度超越其他同类型组合的必要手段。

二季度发生了剧烈的信用事件,导致中低等级信用利差大幅度扩大。基金及时处理了一些中低等级品种债券。在保持杠杆比例稳定的情况下,进行了一些等级拉升置换。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利交利A基金份额净值为1.0296元,本报告期基金份额净值增长率为1.51%;截至本报告期末泰达宏利交利C基金份额净值为1.0296元,本报告期基金份额净值增长率为1.51%;同期业绩比较基准收益率为1.76%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,134,361,000.00	98.24
	其中:债券	3,134,361,000.00	98.24
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,856,711.73	0.06
8	其他资产	54,211,369.29	1.70
9	合计	3,190,429,081.02	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	342,128,000.00	13.80
	其中:政策性金融债	129,329,000.00	5.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,122,948,000.00	45.31
6	中期票据	1,572,515,000.00	63.44
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	96,770,000.00	3.90
9	其他	-	-
10	合计	3,134,361,000.00	126.46

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101551081	15铁道MTN002	2,000,000	196,760,000.00	7.94
2	091302002	13中国华融债02	1,500,000	151,935,000.00	6.13
3	011800249	18南电SCP003	1,500,000	150,645,000.00	6.08
4	011800261	18国电集SCP001	1,500,000	150,540,000.00	6.07
5	011800950	18苏交通SCP009	1,500,000	150,165,000.00	6.06

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

在报告期内,本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内基金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。

5.10.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	54,211,369.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,211,369.29

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.6 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,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	泰达宏利交利债券A	泰达宏利交利债券C
报告期期初基金份额总额	2,407,256,125.96	-
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	2,407,256,125.96	-

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金新增投资本基金。

§8 报告期末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	10,000,000.00	0.42	10,000,000.00	0.42	三年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	-
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	10,000,000.00	0.42	10,000,000.00	0.42	-

本基金的管理人及关联人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20180401-20180630	2,397,256,125.95	0.00	0.00		2,397,256,125.95	99.58%
产品特有风险								
报告期内,本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况,易发生巨额赎回的情况,存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险,以及基金份额净值出现大幅波动的风险。								

注:报告期内,申购份额含红利再投资份额。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于2018年4月28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》,张萍女士因个人健康原因辞去公司督察长职务,由公司总经理刘建先生于4月28日起代为履行公司督察长职务。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利交利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件;
2、《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基金合同》;
3、《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招募说明书》;
4、《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托管协议》;
5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
7、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资人可通过指定信息披露报纸(《上海证券报》)或登录基金管理人互联网网址(http://www.mfcteda.com)查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2018年7月19日

泰达宏利京天宝货币市场基金

2018年第二季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:北京银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月19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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17日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。

本报告期为2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利京天宝货币	
交易代码	004414	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月10日	
报告期末基金份额总额	22,299,719.54份	
投资目标	在严格控制风险,保持流动性的前提下,力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。	
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的长期风险和收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利京天宝货币A	泰达宏利京天宝货币B
下属分级基金的交易代码	004414	004415
报告期末下属分级基金的份额总额	22,299,719.54份	-份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)	
	泰达宏利京天宝货币A	泰达宏利京天宝货币B
1. 本期已实现收益	94,655.75	399,911.13
2. 本期利润	94,655.75	399,911.13
3. 期末基金资产净值	22,299,719.54	-

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.自2018年6月4日起,本基金的B级份额为零。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰达宏利京天宝货币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
过去三个月	0.6206%	0.0110%	0.3366%	0.0000%	0.2840%	0.0110%

泰达宏利京天宝货币B

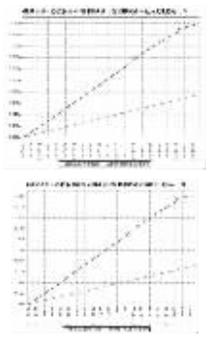
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6206%	0.0110%	0.3366%	0.0000%	0.2948%	0.0130%

注:1、本基金的业绩比较基准:一年期银行定期存款利率(税后)。

2、本基金收益分配按日结转份额。

3、自2018年6月4日起,本基金的B级份额为零。报告期内B级基金及同期业绩比较基准的收益率和收益率标准差数据截止到2018年6月3日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
王靖	本基金基金经理兼副总经理	2017年10月31日	-	11	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;具有11年证券从业经验,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。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。

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 公平交易专项说明

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,未发现利益输送、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%, 在本报告期内出未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

央行在报告期内两次降低商业银行存款准备金率,对市场释放了大量的流动性。同时,市场对于未来降准的预期更加强烈。在股市调整加大的情况下, 中长期利率债品种受到市场追捧,短期内下行幅度明显。信用债而言,则呈现了不同的局面。中低等级信用债品种几乎完全丧失了流动性,信用利差和流动性利差大幅走阔,尤其是民营企业和地方融资平台等发债主体。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期泰达宏利京天宝货币A的基金份额净值收益率为0.6206%, 同期业绩比较基准收益率为0.3366%。本报告期泰达宏利京天宝货币B的基金份额净值收益率为0.5315%,同期业绩比较基准收益率为0.2367%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、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的情形。

2、本报告期内本基金出现连续二十个工作日不满六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,截止报告期末已高于五千万。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	10,001,516.41	44.52
	其中:债券	10,001,516.41	44.52
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	8,900,124.45	39.62
	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	3,217,396.17	14.32
4	其他资产	346,734.97	1.54
5	合计	22,465,772.00	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

本基金本报告期末进行债券回购融资交易。

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。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	6
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	54
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告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(%)
1	30天以内	99.19
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00
2	30天(含)-60天	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00
3	60天(含)-90天	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00
4	90天(含)-120天	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00
5	120天(含)-397天(含)	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00
合计		99.19

5.4 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出现投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末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)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,001,516.41	44.85
	其中:政策性金融债	10,001,516.41	44.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	10,001,516.41	44.85
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

5.7 "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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0725%
报告期内偏离度的最低值	-0.0223%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0217%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现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

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。本基金通过每日计算当日收益并分配,每日支付收益,使基金帐面份额净值始终保持1.00 元。

5.9.2

报告期内基金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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	346,733.97
4	应收申购款	1.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	346,734.97

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	泰达宏利京天宝货币A	泰达宏利京天宝货币B
报告期期初基金份额总额	1,203,097.92	107,507,032.07
报告期期间基金总申购份额	194,527,176.79	85,723,948.23
报告期期间基金总赎回份额	173,430,555.17	193,230,980.30
报告期期末基金份额总额	22,299,719.54	-

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20180601-20180603	0.00	12,009,482.11	12,009,482.11		0.00	0.00%
	2	20180401-20180609	100,222,585.66	385,247.10	100,607,832.76		0.00	0.00%
产品特有风险								
报告期内,本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况,易发生巨额赎回的情况,存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险,以及基金份额净值出现大幅波动的风险。								

注:报告期内,申购份额含红利再投资份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于2018年4月28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》,张萍女士因个人健康原因辞去公司督察长职务,由公司总经理刘建先生于4月28日起代为履行公司督察长职务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会核准泰达宏利京天宝货币市场基金设立的文件;
(二)《泰达宏利京天宝货币市场基金基金合同》;
(三)《泰达宏利京天宝货币市场基金招募说明书》;
(四)《泰达宏利京天宝货币市场基金托管协议》;
(五)基金管理人业务资格批件、营业执照;
(六)基金托管人业务资格批件、营业执照;
(七)中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》、《上海证券报》)或登录基金管理人互联网网址(http://www.mfcteda.com)查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2018年7月19日

泰达宏利京元宝货币市场基金

2018年第二季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:北京银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月19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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17日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。

本报告期间为2018年4月1日至2018年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利京元宝货币	
交易代码	003711	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月23日	
报告期末基金份额总额	13,838,509,368.84份	
投资目标	在严格控制风险,保持流动性的前提下,力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资收益	
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理	
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的长期风险和收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利京元宝货币A	泰达宏利京元宝货币B
下属分级基金的交易代码	003711	003712
报告期末下属分级基金的份额总额	217,905,779.76份	13,620,603,589.08份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)	
	泰达宏利京元宝货币A	泰达宏利京元宝货币B
1. 本期已实现收益	2,800,711.54	100,298,941.81
2. 本期利润	2,800,711.54	100,298,941.81
3. 期末基金资产净值	217,905,779.76	13,620,603,589.08

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰达宏利京元宝货币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
过去三个月	1.0134%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.6768%	0.0010%

泰达宏利京元宝货币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
过去三个月	1.0742%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.7376%	0.0010%

注:1、本基金的业绩比较基准:同期七天通知存款利率(税后)。

2、本基金收益分配按日结转份