

泰达宏利活期友货币市场基金

2018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:中国银行股份有限公司
送出日期:2019年3月27日

§ 1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、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。本年度报告已经全体独立董事签字并由董事长签发。

基金管理人和中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月25日复核了本报告期财务报表、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，复核结果不存在虚假记载、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。

基金过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书及更新。

本报告期财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

本年度报告摘要需摘要自年度报告日起，投资组合情况、年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 泰达宏利活期友货币基金

基金代码 001934

基金运作方式 按照约定开放式

基金合同生效日 2016年11月4日

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

报告期末基金资产总额 270,485,254份

基金合同存续期 不定期

下属分级基金的基金简称: 泰达宏利活期友货币A 泰达宏利活期友货币B

下属分级基金的交易代码: 001934 001936

报告期末下属分级基金的份额总额 226,103,484.42份 46,140,028.12份

2.2 基金产品说明

投资目标 在有效控制风险、保持流动性的前提下,力争为基金份额持有人创造稳定的、高收益回报的投资收益。

投资策略 本基金在深入研究宏观经济的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场价格变化趋势的基础上，分析和判断利率走势、收益曲线变化趋势，从而根据利率走势、收益曲线变化趋势，选择合适的投资品种，通过组合操作，实现基金资产的保值增值。

业绩比较基准 泰达宏利货币型基金净值×100%

风险收益特征 本基金为货币市场基金，风险与收益较低，适合风险承受能力较低的投资者。

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 中国银行股份有限公司

信息披露义务人 陈静 王永冰

电子邮箱 imf@tedafund.com f0409@cnbank.com

客户服务电话 400-699-9999 95566

传真 010-66577606 010-66594942

2.4 信息披露方式

登载在中国证监会指定的管理人互联网网址: http://www.mtdafund.com

基金份额净值发布地点 基金管理人住所地

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 2018年 2017年 2016年

泰达宏利活期友货币A 泰达宏利活期友货币B 泰达宏利活期友货币A 泰达宏利活期友货币B

本期已实现收益 13,473,109,203,285,494 49,845,967,151,630,648,911 30,139,109,800

本期利润 13,473,109,203,285,494 49,845,967,151,630,648,911 30,139,109,800

本期净值增长率 3.762% 3.9846% 3.6142% 3.9822% 2.6101% 2.8574%

3.1.2 期间数据和指标 2018年末 2017年末 2016年末

泰达宏利活期友货币A 泰达宏利活期友货币B 泰达宏利活期友货币A 泰达宏利活期友货币B

期末基金余额 226,108,45,140,202,126,000,000 1,000,000 1,000,000 1,000,000 1,000,000 1,000,000

3.1.3 期间数据和指标 2018年 2017年

泰达宏利活期友货币A 泰达宏利活期友货币B 泰达宏利活期友货币A 泰达宏利活期友货币B

本期已实现收益 13,473,109,203,285,494 49,845,967,151,630,648,911 30,139,109,800

本期利润 13,473,109,203,285,494 49,845,967,151,630,648,911 30,139,109,800

本期净值 3.762% 3.9846% 3.6142% 3.9822% 2.6101% 2.8574%

3.2 本期基金业绩比较基准的变动情况

3.2.1 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

泰达宏利活期友货币A

阶段 份额净值收益率(%) 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%) 净值收益率(%) 准收益基准收益率(%) 准收益基准收益率(%)

过去三个月 0.74% 0.024% 0.340% 0.0000% 0.434% 0.0024%

过去六个月 1.620% 0.042% 0.690% 0.0000% 0.945% 0.0042%

过去一年 3.26% 0.006% 1.350% 0.0000% 2.38% 0.009%

过去二年 10.289% 0.007% 4.053% 0.0000% 6.236% 0.007%

自基金合同生效以来基金的年化收益率 10.061% 0.007% 4.282% 0.0000% 6.437% 0.007%

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

注:本基金业绩比较基准:7天通知存款利率(税后)+0.2%。

本基金定位为货币管理工具,注重基金资产的流动性和安全性,因此采用7天通知存款利率(税后)作为业绩比较基准。7天通知存款利率由中国人民银行公布,如果7天通知存款利率低于业绩比较基准,则以银行定期存款利率作为基准,否则以7天通知存款利率(税后)作为业绩比较基准。

本基金在7天通知存款利率的基础上,根据基金合同约定的有关规定,存在按照基金基准利率的一定比例扣减的费用,从而导致基金的收益率低于业绩比较基准。

3.2.3 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.4 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.5 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.6 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.7 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.8 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.9 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.10 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.11 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.12 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.13 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.14 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.15 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.16 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.17 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.18 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.19 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.20 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.21 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.22 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.23 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.24 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.25 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.26 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.27 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.28 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.29 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.30 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.31 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.32 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.33 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.34 过去三年基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在建仓期结束时及截至