泰达宏利汇利债券型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:包商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21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。

基金托管人包商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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2017年1月1日至2017年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利汇利债券
交易代码	003073
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月30日
报告期末基金份额总额	1,002,316,625.70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、大类资产配置策略 本基金为纯债基金,不做积极主动的大类资产配置。 2、固定收益类资产投资策略 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。
业绩比较基准	中国债券综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券市场中的较低风险品种,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	包商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	泰达宏利汇利债券A / 泰达宏利汇利债券C
下属分级基金的交易代码	003073 / 003074
报告期末下属分级基金的份额总额	1,002,314,417.47份 / 2,208.23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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	泰达宏利汇利债券A	泰达宏利汇利债券C
1. 本期已实现收益	7,382,076.98	10.12
2. 本期利润	3,114,509.48	4.75
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0031	0.0032
4. 期末基金资产净值	999,558,997.83	2,202.73
5. 期末基金份额净值	0.9973	0.9975

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。

3.2 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

泰达宏利汇利债券A

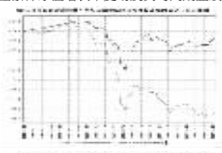
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.32%	0.07%	-1.24%	0.07%	1.56%	0.00%

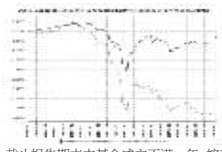
泰达宏利汇利债券C

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	0.36%	0.07%	-1.24%	0.07%	1.60%	0.00%

本基金业绩比较基准:中国债券综合指数收益率

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





本基金成立于2016年8月30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		
庞宝臣	本基金基金经理	2016年8月30日	-	11	2006年7月至2011年8月,任职于永安财产保险股份有限公司,担任投资经理,负责债券研究与投资工作;2011年9月至2012年8月,任职于幸福人寿保险股份有限公司,担任高级经理,固定收益投资室负责人,负责债券投资工作;2012年9月至2014年9月,任职于中华联合保险股份有限公司投资管理部,担任高级主管一职;2014年9月至2016年3月7日,任职于中华联合保险控股股份有限公司,担任投资经理一职;2016年3月10日加入泰达宏利基金管理有限公司,担任固定收益部基金经理一职;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。

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%,在本报告期内也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

报告期内,发达经济体整体向好,通胀走高,美联储加息提前,主要央行货币政策开始转向,但受制于欧洲政治不确定性及"特朗普交易"走弱,海外市场风险偏好区间波动,无风险利率并未进一步提升。

国内经济开局良好,三、四线城市地产销售超预期,工业生产与民间投资平稳增长,PPI持续回升带动非金融企业现金流和利润显著改善,物价上涨温和,经济企稳具备可持续性。

在内、外经济环境相对平稳的情况下,汇率波动趋于平稳,政策焦点更加关注控风险,央行货币政策明确收紧,两次提高公开市场操作工具指导利率,叠加商业银行为满足MPA考核融出资金意愿减弱,资金成本中枢明显提高,推动债券市场收益率稳步抬升,收益率曲线平坦上行,期限利差略有收窄,各等级信用利差受供给收缩影响,相对平稳。

报告期内,我们认为债券市场中高等级债券估值相对合理,但市场整体缺乏弹性,监管风险可能推升流动性溢价,息差交易难有获利空间,纯债组合方面我们采取了防御策略,基于持有票息的考虑,组合仍以信用债为主,考虑本基金的风险收益特征,仓位维持平稳,并延续了中短久期配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利汇利债券A基金份额净值为0.9973元,本报告期基金份额净值增长率为0.32%;截至本报告期末泰达宏利汇利债券C基金份额净值为0.9976元,本报告期基金份额净值增长率为0.36%;同期业绩比较基准收益率为-1.24%。

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	1,097,902,000.00	98.10
	其中:债券	1,097,902,000.00	98.10
	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	2,814,925.43	0.25
8	其他资产	18,502,011.04	1.65
9	合计	1,119,218,936.47	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沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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	59,832,000.00	5.99
	其中:政策性金融债	59,832,000.00	5.99
4	企业债券	114,896,000.00	11.49
5	企业短期融资券	229,472,000.00	22.96
6	中期票据	404,232,000.00	40.44
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	289,470,000.00	28.96
9	其他	-	-
10	合计	1,097,902,000.00	109.84

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	111608271	16中信CD271	1,000,000	96,650,000.00	9.67
2	111615257	16民生CD257	1,000,000	96,410,000.00	9.65
2	111617243	16光大CD243	1,000,000	96,410,000.00	9.65
3	011698880	16川高速SCP005	900,000	89,802,000.00	8.98
4	101652008	16京控MTN001	900,000	86,598,000.00	8.66
5	1280106	12国网债01	800,000	83,120,000.00	8.32

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

本报告期本基金没有投资国债期货。

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	18,502,011.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,502,011.04

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

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	泰达宏利汇利债券A	泰达宏利汇利债券C
报告期期初基金份额总额	1,002,557,063.13	1,200.60
报告期期间基金总申购份额	19.96	2,008.23
减:报告期期间基金总赎回份额	242,665.62	1,000.60
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	1,002,314,417.47	2,208.23

§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	20170101-20170331	999,999,000.00	0.00	0.00		999,999,000.00	99.77
产品持有风险								
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 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利汇利债券型证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利汇利债券型证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利汇利债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利汇利债券型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。

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

投资人可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》、《证券日报》)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
2017年4月21日

泰达宏利活期友货币市场基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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2017年1月1日至2017年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利活期友货币	
交易代码	001894	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年11月4日	
报告期末基金份额总额	1,551,493,353.77份	
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,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	中国银行股份有限公司	
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	001894	001895
报告期末下属分级基金的份额总额	21,908,577.41份	1,529,584,776.36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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	泰达宏利活期友货币A	泰达宏利活期友货币B
1. 本期已实现收益	142,306.63	17,427,615.85
2. 本期利润	142,306.63	17,427,615.85
3. 期末基金资产净值	21,908,577.41	1,529,584,776.36

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

泰达宏利活期友货币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	0.8211%	0.0062%	0.3329%	0.0000%	0.4882%	0.0062%

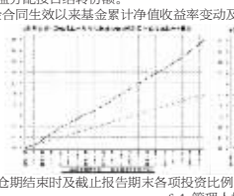
泰达宏利活期友货币B

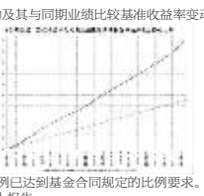
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8807%	0.0062%	0.3329%	0.0000%	0.5478%	0.0062%

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额。

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		
丁宇佳	基金经理	2015年11月4日	-	9	理学学士;2008年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任交易部交易员,负责债券交易工作;2013年9月起先后担任固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理兼固定收益部总经理助理;具备9年基金从业经验,9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%,在本报告期内也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

2017年一季度,海外经济继续低位企稳回升,美联储在进行充分预期管理后加息一次。 国内经济数据亮眼,但市场各方对后续是否能持续存疑。

中国央行坚持金融去杠杆的方向,陆续提高OMO以及MLF等利率,银行间市场流动性出现多次剧烈波动。整体市场收益率较去年四季度有100BP左右上行,但期限利差和评级利差仍然处于历史低位。

操作上,本基金采取相对谨慎的投资策略,大幅降低剩余期限,降低债券以及同业存单比例,保持组合高度流动性。并积极抓住流动性紧张时带来的短期债券的波段机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

活期友A

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0.8211%,同期业绩比较基准增长率为0.3329%。

活期友B

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0.8807%,同期业绩比较基准增长率为0.3329%。

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	固定收益投资	219,921,995.28	14.17
	其中:债券	219,921,995.28	14.17
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	194,928,732.40	12.56
	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	1,131,771,212.66	72.90
4	其他资产	5,866,558.69	0.38
5	合计	1,552,488,499.03	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	1.84	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:上表中,报表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

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	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	19

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(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.92	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	39.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	9.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	19.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	5.81	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.69	-

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	80,115,253.14	5.16
	其中:政策性金融债	80,115,253.14	5.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	89,914,017.80	5.80
6	中期票据	-	-
7	同业存单	49,892,724.34	3.22
8	其他	-	-
9	合计	219,921,995.28	14.17
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011698276	16陕延油SCP004	500,000	49,973,183.49	3.22
2	111694892	16徽商银行CD068	500,000	49,892,724.34	3.22
3	150201	15国开01	400,000	40,152,794.52	2.59
4	041660071	16内蒙电投CP001	400,000	39,940,834.31	2.57
5	150224	15国开24	300,000	29,967,921.19	1.93
6	170401	17农发01	100,000	9,994,537.43	0.64

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	0.0424%
报告期内偏离度的最低值	-0.0326%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0147%

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。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000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	5,866,558.69
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,866,558.69

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	泰达宏利活期友货币A	泰达宏利活期友货币B
报告期期初基金份额总额	20,513,188.17	5,141,407,353.02
报告期期间基金总申购份额	12,065,146.80	1,101,500,667.62
报告期期间基金总赎回份额	10,659,757.56	4,713,323,244.28
报告期期末基金份额总额	21,908,577.41	1,529,584,776.36

§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	20170101-20170117	3,406,176,423.78	4,312,410.56	3,410,488,834.34		0.00	0.00
	2	20170124-20170212	293,109,085.13	12,320,633.25	90,000,000.00		215,429,718.38	13.89
	3	20170112-20170331	908,762,691.97	8,062,122.90	0.00		916,824,814.87	59.09
产品持有风险								
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。								

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

根据《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施<货币市场基金监督管理办法>有关问题的规定》,在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,泰达宏利基金管理有限公司决定修改《泰达宏利活期友货币市场基金基金合同》,详情请见基金管理人于2017年1月19日发布的《关于泰达宏利活期友货币市场基金修改基金合同的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利活期友货币市场基金设立的文件;

2、《泰达宏利活期友货币市场基金基金合同》;

3、《泰达宏利活期友货币市场基金托管协议》;

4、《泰达宏利活期友货币市场基金招募说明书》;

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。

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

投资人可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》、《证券时报》、《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
2017年4月21日

泰达宏利货币市场基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利货币	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	9,884,629,856.11份	
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	本基金的业绩比较基准为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。	
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	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
下属分级基金的交易代码	162206	000700
报告期末下属分级基金的份额总额	147,844,995.78份	9,736,784,860.33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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
1. 本期已实现收益	1,263,070.23	63,680,473.69
2. 本期利润	1,263,070.23	63,680,473.69
3. 期末基金资产净值	147,844,995.78	9,736,784,860.33

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