泰达宏利汇利债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:2019年4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。

基金托管人包商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4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2019年1月1日至2019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	473,216,112.89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	472,898,105.50份	318,007.39份
下属分级基金的风险收益特征	–	–

§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(2019年1月1日 – 2019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	5,427,498.89	104,108.19
2. 本期利润	6,655,675.89	134,491.19
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0134	0.0212
4. 期末基金资产净值	503,958,031.84	338,246.54
5. 期末基金份额净值	1.0657	1.0636

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

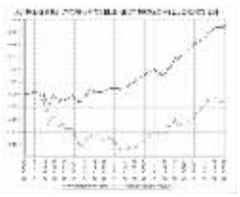
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.23%	0.03%	0.47%	0.05%	0.76%	-0.02%

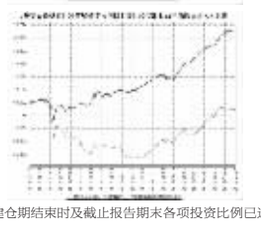
泰达宏利汇利债券C

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	1.32%	0.04%	0.47%	0.05%	0.85%	-0.01%

注: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





注：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9月26日	–	13	西安交通大学理学硕士;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,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,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;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;2016年3月10日加入泰达宏利基金管理有限公司,曾任固定收益部基金经理助理,现任基金经理;具备13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 管理人对投资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,全球经济延续放缓态势,联储暂停加息,虽然国内经济仍处弱势,工业生产继续放缓,但融资条件改善,社融企稳,中美贸易谈判取得进展,减税降费提振市场的盈利预期,投资者风险偏好明显改善,风险资产表现突出,债券市场表现相对平淡。得益于货币政策对流动性的呵护,资金价格稳定在低位水平,短期品种收益率仍有所下行,信用利差有所收敛;受增长预期改善影响,中长期品种震荡略有上行,收益率曲线陡峭化变动。

本报告期内,本组合主要以骑乘策略为主,投资于3年以内品种,久期维持低位,净值表现优于比较基准。

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1.0657元,本报告期基金份额净值增长率为1.23%；截至本报告期末泰达宏利汇利债券C基金份额净值为1.0636元,本报告期基金份额净值增长率为1.32%;同期业绩比较基准收益率为0.47%。

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	602,250,500.00	97.92
	其中:债券	587,043,500.00	95.45
	资产支持证券	15,207,000.00	2.47
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	764,988.49	0.12
8	其他资产	12,035,520.90	1.96
9	合计	615,051,009.39	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	314,069,000.00	62.28
	其中:政策性金融债	314,069,000.00	62.28
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	118,015,500.00	23.40
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	154,959,000.00	30.73
9	其他	–	–
10	合计	587,043,500.00	116.41

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	180313	18进出13	1,000,000	101,390,000.00	20.11
2	180202	18国开02	900,000	91,494,000.00	18.14
3	170305	17进出05	500,000	50,640,000.00	10.04
4	111870328	18贵州银行CD047	500,000	48,780,000.00	9.67
5	111871108	18武汉农商行CD050	500,000	48,415,000.00	9.60

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149702	18光大优	150,000	15,207,000.00	3.02

注:以上为本基金本报告期末持有的全部资产支持证券投资。

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

本基金在报告期末投资于国债期货。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

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	6,655.65
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	12,028,865.25
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	12,035,520.90

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	934,778,200.58	28,627,737.49
报告期期间基金总申购份额	472,746,878.35	10,083,857.19
减:报告期期间基金总赎回份额	934,626,973.43	38,393,587.29
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	472,898,105.50	318,007.39

§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	20190101-20190108	428,121,967.46	0.00	428,121,967.46	0.00	0.00%
	2	20190101-20190102	496,887,485.51	472,708,793.19	496,887,485.51	472,708,793.19	99.89%
	3	20190108-20190331	496,887,485.51	472,708,793.19	496,887,485.51	472,708,793.19	99.89%
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。

§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》)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
2019年4月19日

泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:2019年4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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4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2019年1月1日至2019年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利绩优混合
交易代码	005903
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月13日
报告期末基金份额总额	154,938,870.11份
投资目标	本基金通过系统化评估方法紧跟新时代国民经济发展过程中符合绩优增长特征的上市公司投资机遇,基于类别资产配置策略,力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金综合GARP投资策略和可持续发展投资(ESG)形成本基金的投资理念,认为基金超额收益来源于优质企业，优质企业需要价值和成长并重(Growth at a Reasonable Price,简称GARP投资策略)，并且将环境(Environment)、公司治理(Corporate Governance)、企业社会责任(Social Responsibility)的因素纳入企业的企业经营中,不断提高可持续发展的能力。 本基金股票投资力求发掘"业绩加速成长且有潜力成为或已经成为行业优质龙头公司"。流程上是"量化+主动"的个股投资策略。将采用量化初筛、基本面核实、深化比较相结合的研究方法进行投资。首先,本基金基于公司财务指标进行量化初筛。具体的考察指标包括成长性指标、盈利指标、现金流、财务稳健性等指标。结合相关财务模型的分析,形成初选股票池。其次,公司投资研究人员将通过案头研究和实地调研等基本面研究方法对初选股票的基本面进行核实。重点关注初选股票的盈利持续性和盈利质量等指标,形成二选股票。再次,对二选股票进行深化比较,形成企业盈利预测、公司估值预测和未来目标收益预测。在此基础上,叠加公司在环境、公司治理和企业社会责任方面的实施情况，并且识别个股集中度,对行业适度分散。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。
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

§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(2019年1月1日 – 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-66,615.28
2.本期利润	27,965,191.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.1694
4.期末基金资产净值	162,933,165.04
5.期末基金份额净值	1.0516

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

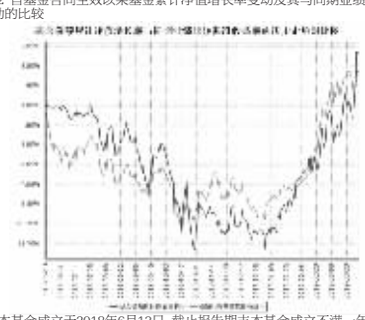
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	19.55%	1.12%	15.33%	0.77%	4.22%	0.35%

注:本基金的业绩比较基准为:中证全指指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%

本基金选择市场认同度较高、行业分类标准和指数编制方法较为科学的中证全指指数收益率作为本基金股票组合的业绩比较基准。中证全指指数由中证指数公司编制,并与2011年8月2日发布,指数由剔除ST,*ST股票,以及上市时间不足3个月等股票后的剩余股票构成样本股,采用市值加权的方式编制而成。指数涵盖主板、中小板、创业板,可以综合反映沪深A股市场整体表现。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,其选样是在中证全债指数样本的基础上,增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债和企业债,旨在全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。该指数具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势。本基金管理人认为,以中证全指指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金持有人理性判断本基金产品的风险收益特征。

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2018年6月13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		
吴华	本基金基金经理	2018年6月13日	–	15	北京大学金融学硕士;2004年6月至2006年3月就职于易方达基金管理有限公司,担任宏观策略分析员;2006年4月至2011年4月就职于中国国际金融有限公司，先后就职于研究部、资产管理部,担任经理、副总经理等职位;2011年5月加入泰达宏利基金管理有限公司,现任基金经理;具备15年证券从业经验,15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 管理人对投资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

过去3个月,市场总体特征是风险偏好的剧烈提升。表现为:游资主导品种涨幅居前,(比如业绩微雷指数剧烈上涨),传统的风险偏好高的板块(比如计算机)也有不错的涨幅,而低风险偏好的稳健类资产几乎没有上涨。

本基金的策略是长线持有业绩稳健成长的优质龙头公司。秉承这个思路,基金经理在波澜壮阔的高风险偏好行情中，并未改变一贯的投资风格去追逐高风险偏好资产,但本基金按照基本面情况对组合进行了调整。首先,随着2018年年报的披露,本基金对年报超预期、1季报业绩预计也有望超预期的个股做了增持。第二,由于生猪价格未来上涨的幅度超过了基金经理此前的预期,基金也做了相应的调整。基金整体上保持了稳健的操作和较低的换手率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0516元；本报告期基金份额净值增长率为19.55%,业绩比较基准收益率为15.33%。

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	154,020,160.94	94.05
	其中:股票	154,020,160.94	94.05
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	182,600.00	0.11
	其中:债券	182,600.00	0.11
	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	8,725,899.71	5.33
8	其他资产	827,033.43	0.51
9	合计	163,755,694.08	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	87,508,160.89	53.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,095,522.00	4.35
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	1,325,376.00	0.81
G	交通运输、仓储和邮政业	17,266,227.80	10.60
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,617,451.25	5.90
J	金融业	28,064,071.00	17.22
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	2,964,712.00	1.82
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	178,640.00	0.11
S	综合	–	–
	合计	154,020,160.94	94.53

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	16,083	13,734,721.17	8.43
2	600276	恒瑞医药	179,671	11,754,076.82	7.21
3	603899	晨光文具	306,400	11,336,800.00	6.96
4	002032	苏泊尔	148,907	11,172,492.21	6.86
5	600036	招商银行	325,400	11,037,568.00	6.77
6	603288	海天味业	121,540	10,537,518.00	6.47
7	002410	广联达	322,625	9,617,451.25	5.90
8	002841	视源股份	121,040	9,598,472.00	5.89
9	600548	深高速	802,200	8,463,210.00	5.19
10	600900	长江电力	420,600	7,095,522.00	4.35

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	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	182,600.00	0.11
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	182,600.00	0.11

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	128059	视源转债	1,826	182,600.00	0.11

注:以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

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

本基金本报告期末无投资资产支持证券。

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本报告期末投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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的情况的说明

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	63,855.60
2	应收证券清算款	761,329.15
3	应收股利	–
4	应收利息	1,848.68
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	827,033.43

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	172,622,778.14
报告期期间基金总申购份额	191,168.09
减:报告期期间基金总赎回份额	17,875,076.12
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	154,938,870.11

§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 影响投资者决策的其他重要信息

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。

§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绩优增长灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利绩优增长灵活配置混合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》)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
2019年4月19日

泰达宏利活期友货币市场基金

2019年第一季度报告

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:2019年4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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4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2019年1月1日至2019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	213,719,871.76份
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,分析利率期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	177,746,630.13份	35,973,241.63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(2019年1月1日 – 2019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	1,605,810.66	420,912.72
2. 本期利润	1,605,810.66	420,912.72
3. 期末基金资产净值	177,746,630.13	35,973,241.63

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