

泰达宏利货币市场基金 2010 年年度报告

2010 年 12 月 31 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

报告送出日期：2011 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司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。本年度报告已经全体独立董事签字同意，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 2011 年 3 月 25 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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司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 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	13
§7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表	14
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	18
§8 投资组合报告	36
8.1 期末基金资产组合情况	36
8.2 债券回购融资情况	36
8.3 基金投资组合平均剩余期限	37
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
8.5 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	38
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	38
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	39
8.8 投资组合报告附注	39

§9 基金份额持有人信息	39
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	40
§10 开放式基金份额变动	40
§11 重大事件揭示	40
11.1 基金份额持有人大会决议	40
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	40
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
11.4 基金投资策略的改变	40
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	41
11.9 其他重大事件	41
§12 影响投资者决策的其他重要信息	42
§13 备查文件目录	42
13.1 备查文件目录	42
13.3 查阅方式	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利货币市场基金
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	474,442,918.13 份
基金合同存续期	持续经营

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	邢颖	李芳菲
	联系电话	010-66577725	010-66060069
	电子邮箱	irm@mfteda.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95599
传真		010-66577666	010-63201816
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区金融大街 7	北京市西城区复兴门内大街 28

	号英蓝国际金融中心南楼 三层	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	刘惠文	项俊波

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http:// www.mfcteda.com
基金年度报告报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	泰达宏利基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

§ 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	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	16,287,283.19	23,378,726.26	21,834,135.45
本期利润	16,287,283.19	23,378,726.26	21,834,135.45
本期净值收益率	1.8345%	1.3487%	2.9010%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末基金资产净值	474,442,918.13	2,862,765,943.23	3,929,025,549.03
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
累计净值收益率	11.8992%	9.8834%	8.4215%

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. 本基金基金合同于 2005 年 11 月 10 日生效。

4. 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

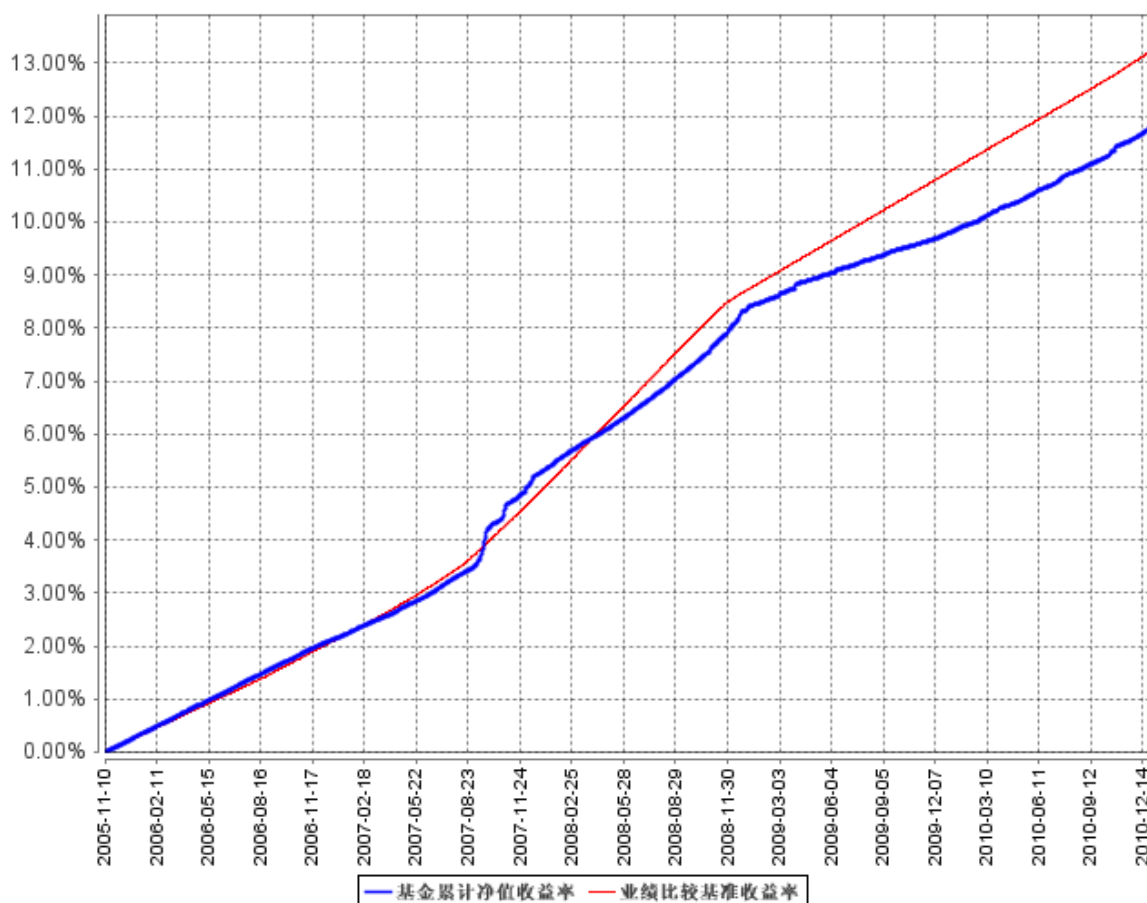
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.5633%	0.0061%	0.5671%	0.0000%	-0.0038%	0.0061%
过去六个月	1.0131%	0.0052%	1.1884%	0.0004%	-0.1753%	0.0048%
过去一年	1.8345%	0.0043%	2.3041%	0.0003%	-0.4696%	0.0040%
过去三年	6.2016%	0.0053%	8.3266%	0.0020%	-2.1250%	0.0033%
过去五年	11.6032%	0.0064%	12.9915%	0.0021%	-1.3883%	0.0043%
自基金合同 生效日起至 今	11.8992%	0.0063%	13.2479%	0.0021%	-1.3487%	0.0042%

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

基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

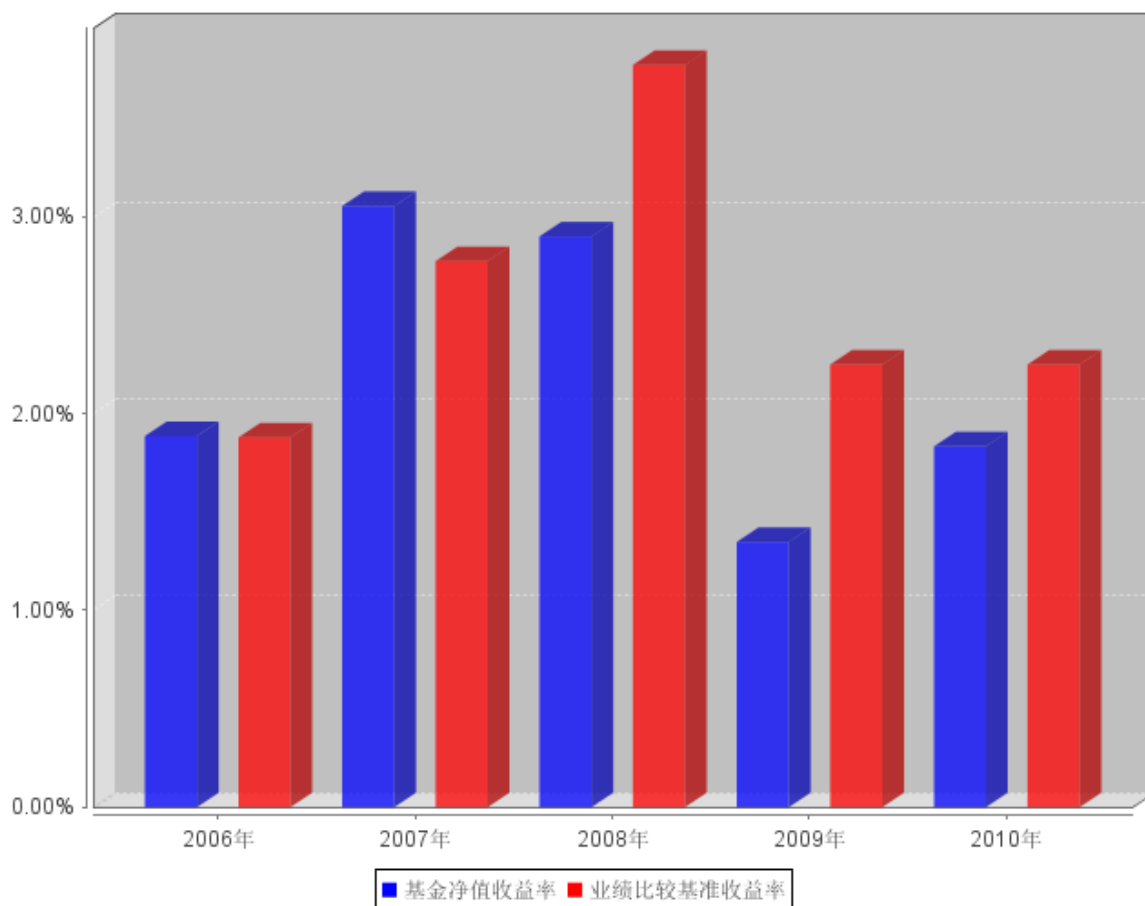


注：本基金成立于 2005 年 11 月 10 日，在建仓期结束时及截止报告期末本基金的各项投资比例已

达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 过去五年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

过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2005 年 11 月 10 日生效，2005 年年度净值收益率的计算期间为 2005 年 11 月 10 日至 2005 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2010年	14,706,863.66	2,151,787.27	-571,367.74	16,287,283.19	
2009年	22,366,739.09	4,248,785.83	-3,236,798.66	23,378,726.26	
2008年	15,336,896.16	3,049,612.35	3,447,626.94	21,834,135.45	
合计	52,410,498.91	9,450,185.45	-360,539.46	61,500,144.90	

§ 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在内的十三只开放式证券投资基金。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡振仓	本基金基金经理	2008 年 8 月 9 日	—	8	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，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。8 年证券从业经验，5 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。表中的任职日期和离任日期均指公司做出决定的公告日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，未发生任何利益输送的情况。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本公司旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度，在本报告期内未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

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

2010 年，国际上，欧元区受主权债务危机困扰，除德国等少数国家外，经济增长乏善可陈，美国经济前 3 季度较弱，4 季度开始出现一些转好的迹象，但走向复苏尚待时日。相比而言，国内经济回升向好的势头逐步巩固，尽管期间出现过短暂的回落，在 8 月底出现企稳迹象以来，四季度增长较为强劲。

政策上，美国、日本、欧洲全年继续维持刺激政策，甚至在 4 季度再度实行大规模量化宽松政策，美国还意外地延续了上任政府的减税政策，刺激增长的意图非常明确。而国内则在 1 季度货币政策开始逐步退出，整个全年央行加息 2 次、上调存款准备金率 6 次，同时对部分商业银行实行了差别存款准备金率，政策退出时间和力度都大大超出了市场的预期。

从货币市场看，除一季度由于均衡信贷投放使得货币市场资金极为充裕之外，2 季度末开始资金的结构性紧缺状况不断加剧。货币市场收益率不断创出新高，到了 4 季度，甚至出现了 7 天回购长时间持续在 6% 以上、1 年期以内央票收益率到 3.7% 以上的情形，确实大大超出了市场和我们的预期。从基金运作看，本基金年内基本采取相对谨慎的策略，维持较高的现金比例和相对较

低的组合久期，较好地回避了市场深幅调整，但由于年内基金规模有所下降，阶段性对组合操作影响较大。

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 元，本报告期份额净值增长率为 1.8345%，同期业绩比较基准增长率为 2.3041%。

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 2011 年，按照中央经济工作会议精神，明年的货币政策将回归中性，在这大背景下，尽管央行已经提前有所行动，但考虑到明年国内增长趋势较为确定，通胀可能依然会超出预期，央行有可能会在 1 季度再次上调利率，准备金政策则依然处于优先使用的位置。资金面上，考虑到明年央行对信贷调控方式的转变，资金的结构紧张状况有可能比今年要严峻，货币市场利率会保持在一个相对较高的位置，本基金的收益率也将有所上升。经过大幅调整之后，市场再度大幅调整的可能性较低，策略上，尽管会依然保持谨慎，但将适度提高组合久期，积极关注部分中高信用等级产品及中短期限浮动利率产品，积极把握货币市场的波段性投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，督察长、监察稽核部门、风险控制部门定期与不定期的对基金的投资、交易、研发、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会 2008 年 9 月 12 日发布的[2008] 38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立长期停牌股票等没有市价的投资品种估值委员会，成员由主管基金运营的副总经理、督察长、投资总监、基金经理及研究部、交易部、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组成。职责分工、专业胜任能力和相关工作经历具体如下：

主管基金运营的副总经理担任估值委员会主任，督察长、投资总监担任副主任。主要负责估值委员会的组织、管理工作，并对涉及估值委员会的重大事项做出决策。

基金经理:基金经理参与估值委员会的日常工作，主要对长期停牌股票行业类别和重估方法提出建议。参与估值的基金经理具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较为丰富的经验，熟悉

相关法律法规和估值方法。

研究部负责人及行业研究员：负责长期停牌股票等没有市价的投资品种所属行业的专业研究，参与长期停牌股票行业类别和重估方法的确定。他们具有多年的行业研究经验，能够较好的对行业发展趋势做出判断，熟悉相关法律法规和估值方法。

交易部负责人：参与估值委员会的日常工作，主要对长期停牌股票的行业类别和重估方法提出建议。该成员具有多年的股票交易经验，能够较好的对市场的波动及发展趋势作出判断，熟悉相关的法律法规和估值方法。

监察稽核部负责人：负责对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督，发现问题及时要求整改。该成员具有一定的会计核算估值知识和经验，熟知与估值政策相关的各项法律法规，了解估值原则和估值方法。

金融工程部负责人：负责估值相关数值的处理和计算，确定行业指数，计算估值价格，参与确定估值方法。该成员在金融工程工作方面具有较为丰富的经验，具备应用多种估值模型的专业能力，熟悉相关法律法规和估值方法。

风险管理部负责人：负责估值相关数值的处理和计算，复核由金融工程部提供的行业指数和估值价格。该成员在基金的风险控制与绩效评估工作方面具有较为丰富的经验，熟悉相关法律法规和估值方法。

基金运营部负责人：参与长期停牌股票估值方法的确定，并与相关托管行进行核对确认，如有不符合的情况出现，立即向估值委员会反映情况，并提出合理的调整建议。该成员具备多年基金从业经验，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉基金估值法律法规、政策和估值方法。

基金经理参与估值委员会对相关停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌股票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。

本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.8 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 2010 年累计分配收益 16,287,283.19 元，已于每月中旬集中转结至基金持有人账户。

§ 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证券投资基金的过程中，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》相关法律法规的规定以及《泰达宏利货币市场证券投资基金基金合同》、《泰达宏利货币市场证券投资基金托管协议》的约定，对泰达宏利货币市场证券投资基金管理人—泰达宏利基金管理有限公司 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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证券投资基金的投资运作、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证券投资基金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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2011)第 20399 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰达宏利货币市场基金全体基金份额持有人

引言段	我们审计了后附的泰达宏利货币市场基金的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是泰达宏利货币市场基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：(1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；(2) 选择和运用恰当的会计政策；(3) 作出合理的会计估计。
注册会计师的责任段	我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了泰达宏利货币市场基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	汪棣 单峰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2011 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利货币市场基金

报告截止日： 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	50,308,914.05	1,385,650,693.81
结算备付金		409,090.91	12,355,238.10
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	220,449,163.03	657,293,954.87
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		220,449,163.03	657,293,954.87
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	171,000,570.00	795,702,033.55
应收证券清算款		-	10,442,785.48
应收利息	7.4.7.5	1,449,318.46	3,532,207.72
应收股利		-	-
应收申购款		60,999,896.92	4,200.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		504,616,953.37	2,864,981,113.53
负债和所有者权益	附注号	本期期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 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		28,999,785.50	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		118,826.51	349,332.39
应付托管费		36,008.06	105,858.33
应付销售服务费		90,020.12	264,645.75
应付交易费用	7.4.7.7	14,900.99	13,116.89
应交税费		-	-
应付利息		3,644.86	-
应付利润		546,349.20	1,117,716.94
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	364,500.00	364,500.00
负债合计		30,174,035.24	2,215,170.30
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	474,442,918.13	2,862,765,943.23

未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		474,442,918.13	2,862,765,943.23
负债和所有者权益总计		504,616,953.37	2,864,981,113.53

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 474,442,918.13 份。

7.2 利润表

会计主体：泰达宏利货币市场基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
一、收入		23,991,233.66	35,459,518.83
1. 利息收入		20,407,710.65	29,092,067.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,078,074.01	8,480,948.31
债券利息收入		11,190,028.72	17,230,903.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,139,607.92	3,380,215.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,583,523.01	6,367,450.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,583,523.01	6,367,450.94
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		7,703,950.47	12,080,792.57
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,168,354.38	5,664,668.50
2. 托管费	7.4.10.2.2	960,107.39	1,716,566.29
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,400,268.43	4,291,415.63
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		796,878.25	30,142.15
其中：卖出回购金融资产支出		796,878.25	30,142.15
6. 其他费用	7.4.7.20	378,342.02	378,000.00
三、利润总额		16,287,283.19	23,378,726.26

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,287,283.19	23,378,726.26

7.3 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：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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）	2,862,765,943.23	-	2,862,765,943.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,287,283.19	16,287,283.19
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）	-2,388,323,025.10	-	-2,388,323,025.10
其中：1. 基金申购款	2,783,842,660.14	-	2,783,842,660.14
2. 基金赎回款	-5,172,165,685.24	-	-5,172,165,685.24
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）	-	-16,287,283.19	-16,287,283.19
五、期末所有者权益（基金净值）	474,442,918.13	-	474,442,918.13
项目	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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）	3,929,025,549.03	-	3,929,025,549.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,378,726.26	23,378,726.26
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）	-1,066,259,605.80	-	-1,066,259,605.80
其中：1. 基金申购款	10,856,945,405.91	-	10,856,945,405.91
2. 基金赎回款	-11,923,205,011.71	-	-11,923,205,011.71

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）	-	-23,378,726.26	-23,378,726.26
五、期末所有者权益（基金净值）	2,862,765,943.23	-	2,862,765,943.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 缪钧伟 </u>	<u> 傅国庆 </u>	<u> 王泉 </u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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 2011 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本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”）、中国证监会公告[2010]5 号《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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(ii) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(iii) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并按基金份额面值 1.00 元分配后转入所有者权益，每月集中宣告收益分配并将当月收益结转至投资人基金账户。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，

则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的“影子定价”的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定“影子定价”的公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内，无会计政策的变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内，无会计估计的变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内，无重大会计差错发生。

7.4.6 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》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 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。
- (2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	308,914.05	1,385,650,693.81

定期存款	50,000,000.00	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	50,308,914.05	1,385,650,693.81

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2010 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	220,449,163.03	219,512,000.00	-937,163.03	-0.1975%
	合计	220,449,163.03	219,512,000.00	-937,163.03	-0.1975%
项目		上年度末 2009 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	657,293,954.87	657,996,648.18	702,693.31	0.0245%
	合计	657,293,954.87	657,996,648.18	702,693.31	0.0245%

注：于 2010 年 12 月 31 日，交易性金融资产均为银行间同业市场债券投资，摊余成本近似于公允价值，无估值增值/(减值)，2009 年 12 月 31 日同。

1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；
2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

截止报告期末，本基金无衍生金融资产/负债，2009 年同。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	31,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	140,000,570.00	-
合计	171,000,570.00	-

各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	795,702,033.55	-
合计	795,702,033.55	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券，2009 年同。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,278.26	153,035.00
应收定期存款利息	16,805.56	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	143.20	37,959.30
应收债券利息	1,093,537.90	3,009,347.94
应收买入返售证券利息	330,837.63	297,854.15
应收申购款利息	5,715.91	34,011.33
其他	-	-
合计	1,449,318.46	3,532,207.72

7.4.7.6 其他资产

截止报告期末，本基金无其他资产余额，2009 年同。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	14,900.99	13,116.89
合计	14,900.99	13,116.89

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	364,500.00	364,500.00
合计	364,500.00	364,500.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,862,765,943.23	2,862,765,943.23
本期申购	2,783,842,660.14	2,783,842,660.14
本期赎回（以“-”号填列）	-5,172,165,685.24	-5,172,165,685.24
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	474,442,918.13	474,442,918.13

注：红利再投资包括本年度收益分配中以红利再投资方式结转入实收基金 14,706,863.66 元（附注 7.4.11）。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	16,287,283.19	-	16,287,283.19
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-16,287,283.19	-	-16,287,283.19
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	6,997,256.27	312,668.11
定期存款利息收入	16,805.56	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	23,467.43	8,030,038.09
其他	40,544.75	138,242.11
合计	7,078,074.01	8,480,948.31

注：其他收入为直销申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期内，本基金无股票投资，2009 年同。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12 月31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	1,904,461,548.31	3,645,396,606.74
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	1,885,577,538.90	3,626,998,380.38
减：应收利息总额	15,300,486.40	12,030,775.42
债券投资收益	3,583,523.01	6,367,450.94

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本报告期内，本基金未投资资产支持证券，2009 年同。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期内，本基金未投资衍生工具，2009 年同。

7.4.7.16 股利收益

本报告期内，本基金未有股利收益，2009 年同。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本报告期内，本基金未有公允价值变动收益，2009 年同。

7.4.7.18 其他收入

本报告期内，本基金无其他收入，2009 年同。

7.4.7.19 交易费用

本报告期内，本基金无交易费用，2009 年同。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	280,000.00	280,000.00

债券托管帐户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	270.00	-
其他	72.02	-
合计	378,342.02	378,000.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本报告期内，本基金无或有事项，2009 年同。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本报告期内，本基金无资产负债表日后事项，2009 年同。

7.4.9 关联方关系

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（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
宏利资产管理(香港)有限公司	基金管理人的股东
法国巴黎投资管理亚洲有限公司(原“荷银投资管理(亚洲)有限公司”)	基金管理人的原股东

注：根据本基金的基金管理人 2010 年 3 月 9 日发布的《泰达荷银基金管理有限公司关于股权变更及公司更名的公告》的有关规定，经公司 2009 年第五次股东会审议通过并经中国证监会证监许可[2010]166 号文批准，本基金的基金管理人原外方股东荷银投资管理(亚洲)有限公司将所持有的公司全部 49%的股权转让给宏利资产管理(香港)有限公司。变更后的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%。营业执照于 2010 年 3 月 4 日完成变更。

2010 年 4 月 1 日，法国巴黎投资与富通资产管理集团完成合并，合并后本基金管理人的原股东荷银投资管理(亚洲)有限公司以法国巴黎投资管理亚洲有限公司(BNP Paribas Investment Partners Asia Limited)的名称营运。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易，2009 年同。

7.4.10.1.1.2 债券交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行债券投资，2009 年同。

7.4.10.1.1.3 债券回购交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易，2009 年同。

7.4.10.1.2 权证交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易，2009 年同。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期内，本基金无应支付关联方的佣金，2009 年同。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,168,354.38	5,664,668.50
其中：支付销售机构的客户维护费	309,505.44	555,802.42

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 × 0.33% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	960,107.39	1,716,566.29

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 × 0.1% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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	
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
泰达宏利	1,697,803.95	
中国农业银行	153,475.21	
合计	1,851,279.16	
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间	
	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
泰达宏利	2,989,120.97	
中国农业银行	462,777.09	
合计	3,451,898.06	

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×0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 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

本期						
2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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	20,220,342.39	40,643,691.83	-	-	112,520,000.00	12,106.46
上年度可比期间						
2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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	-	336,361,111.36	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，未有运用固有资金投资本基金的情况。（2009 年：同）

7.4.10.4.2 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 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 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	249.11	0.00	246.22	0.00

7.4.10.5 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 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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	298,557.46	16,235.14	1,650,693.81	161,141.44

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金未有在承销期内参与关联方承销证券的情况，2009 年同。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内，无其他关联交易事项，2009 年同。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
14,706,863.66	2,151,787.27	-571,367.74	16,287,283.19	-

注：本基金在本年度累计分配收益 16,287,283.19 元，与年初应付利润 1,117,716.94 元，共计 17,405,000.13 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 14,706,863.66 元(附注 7.4.7.9)，包含于赎回款的已分配未支付收益 2,151,787.27 元，计入应付收益科目 546,349.20 元。

7.4.12 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末，本基金未持有暂时停牌的证券，2009 年同。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末，本基金未持有暂时停牌的股票，2009 年同。

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 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 28,999,785.50 元，是以如下债券作为抵押：

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
070211	07 国开 11	2011 年 1 月 4 日	100.91	200,000	20,181,651.85
100231	10 国开 31	2011 年 1 月 4 日	99.96	100,000	9,995,780.63
合计				300,000	30,177,432.48

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金未有交易所市场债券正回购，2009 年同。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行中国农业银行以及中信银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海银行，与该银行存款相关的信用风险不重大；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
A-1	100,044,189.96	410,084,487.85
A-1 以下	-	-
未评级	120,404,973.07	247,209,467.02
合计	220,449,163.03	657,293,954.87

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有按长期信用评级的债券投资 (2009 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值且正回购余额在每个交易日均不超过基金资产净值的 20%。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2010 年 12 月 31 日	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	合计
资产					
银行存款	50,308,914.05	-	-	-	50,308,914.05
结算备付金	409,090.91	-	-	-	409,090.91
交易性金融资产	225,500.00	267,898,900.00	20,451,000.00	-	288,575,400.00
买入返售金融资产	171,594,961.18	-	-	-	171,594,961.18
应收申购款	60,999,896.92	-	-	-	60,999,896.92
资产总计	283,538,363.06	267,898,900.00	20,451,000.00	-	571,888,263.06
负债					
卖出回购金融资产款	29,014,364.93	-	-	-	29,014,364.93
应付管理人报酬	118,826.51	-	-	-	118,826.51
应付托管费	36,008.06	-	-	-	36,008.06
应付销售服务费	90,020.12	-	-	-	90,020.12
应付交易费用	14,900.99	-	-	-	14,900.99
应付利润	546,349.20	-	-	-	546,349.20
其他负债	364,500.00	-	-	-	364,500.00
负债总计	30,184,969.81	-	-	-	30,184,969.81
流动性净额	253,353,393.25	267,898,900.00	20,451,000.00	-	541,703,293.25
上年度末 2009 年 12 月 31 日	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	合计
资产	-	-			-
银行存款	1,385,650,693.81	-	-	-	1,385,650,693.81
结算备付金	12,355,238.10	-	-	-	12,355,238.10
交易性金融资产	111,298,400.00	558,044,800.00	-	-	669,343,200.00
买入返售金融资产	796,248,271.10	-	-	-	796,248,271.10
应收证券清算款	10,442,785.48	-	-	-	10,442,785.48
应收申购款	4,200.00	-	-	-	4,200.00
资产总计	2,315,999,588.49	558,044,800.00	-	-	2,874,044,388.49
负债					
应付管理人报酬	349,332.39	-	-	-	349,332.39
应付托管费	105,858.33	-	-	-	105,858.33
应付销售服务费	264,645.75	-	-	-	264,645.75

应付交易费用	13,116.89	-	-	-	13,116.89
应付利润	1,117,716.94	-	-	-	1,117,716.94
其他负债	364,500.00	-	-	-	364,500.00
负债总计	2,215,170.30	-	-	-	2,215,170.30
流动性净额	2,313,784,418.19	558,044,800.00	-	-	2,871,829,218.19

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过影子定价对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	50,308,914.05	-	-	-	-	50,308,914.05
结算备付金	409,090.91	-	-	-	-	409,090.91
存出保证金	-	-	-	-	-	0.00
交易性金融资产	60,450,024.38	159,999,138.65	-	-	-	220,449,163.03
买入返售金融资产	171,000,570.00	-	-	-	-	171,000,570.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	0.00
应收利息	-	-	-	-	1,449,318.46	1,449,318.46
应收申购款	50,211,700.00	-	-	-	10,788,196.92	60,999,896.92
资产总计	332,380,299.34	159,999,138.65	-	-	12,237,515.38	504,616,953.37
负债						
卖出回购金融资产款	28,999,785.50	-	-	-	-	28,999,785.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	118,826.51	118,826.51
应付托管费	-	-	-	-	36,008.06	36,008.06
应付销售服务费	-	-	-	-	90,020.12	90,020.12
应付交易费用	-	-	-	-	14,900.99	14,900.99

应付利息					3,644.86	3,644.86
应付利润					546,349.20	546,349.20
其他负债					364,500.00	364,500.00
负债总计	28,999,785.50				1,174,249.74	30,174,035.24
利率敏感度缺口	303,380,513.84	159,999,138.65			11,063,265.64	474,442,918.13
上年度末 2009 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	1,385,650,693.81					1,385,650,693.81
结算备付金	12,355,238.10					12,355,238.10
交易性金融资产	150,121,277.36	507,172,677.51				657,293,954.87
买入返售金融资产	795,702,033.55					795,702,033.55
应收证券清算款					10,442,785.48	10,442,785.48
应收利息					3,532,207.72	3,532,207.72
应收申购款					4,200.00	4,200.00
资产总计	2,343,829,242.82	507,172,677.51			13,979,193.20	2,864,981,113.53
负债						
应付管理人报酬					349,332.39	349,332.39
应付托管费					105,858.33	105,858.33
应付销售服务费					264,645.75	264,645.75
应付交易费用					13,116.89	13,116.89
应付利润					1,117,716.94	1,117,716.94
其他负债					364,500.00	364,500.00
负债总计					2,215,170.30	2,215,170.30
利率敏感度缺口	2,343,829,242.82	507,172,677.51			11,764,022.90	2,862,765,943.23

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 年 12 月 31 日，在影子定价机制有效的前提下，若市场利率变动 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会产生重大变动(2009 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层级的余额，第二层级的余额为 220,449,163.03 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：无属于第一层级的余额，第二层级的余额为 657,293,954.87 元，无属于第三层级的余额)。本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	220,449,163.03	43.69
	其中：债券	220,449,163.03	43.69
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	171,000,570.00	33.89
	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	50,718,004.96	10.05
4	其他各项资产	62,449,215.38	12.38
5	合计	504,616,953.37	100.00

8.2 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	6.28	
	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	28,999,785.50	6.11
	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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	121
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	160
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	51

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

报告期内，本基金投资组合未发生平均剩余期限超过 180 天的情况。

8.3.2 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	36.19	6.11
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天(含)—60 天	10.54	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天(含)—90 天	10.63	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	10.63	—
4	90 天(含)—180 天	2.11	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
5	180 天(含)—397 天（含）	33.72	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
合计		93.19	6.11

8.4 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	120,404,973.07	25.38
	其中：政策性金融债	120,404,973.07	25.38
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,044,189.96	21.09
6	其他	-	-
7	合计	220,449,163.03	46.46
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	50,454,129.63	10.63

注：付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。

8.5 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	070211	07 国开 11	500,000	50,454,129.63	10.63
2	100226	10 国开 26	500,000	49,959,282.18	10.53
3	1081232	10 天音 CP01	200,000	20,021,631.08	4.22
4	1081257	10 稀土 CP01	200,000	20,012,498.04	4.22
5	1081377	10 桂交投 CP01	200,000	20,000,447.28	4.22
6	100231	10 国开 31	200,000	19,991,561.26	4.21
7	1081362	10 辰州矿 CP02	100,000	10,011,409.36	2.11
8	1081336	10 华润 CP02	100,000	10,001,690.71	2.11
9	1081400	10 赣粤 CP03	100,000	10,000,618.74	2.11
10	1081360	10 华天 CP01	100,000	9,995,894.75	2.11

8.6 “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	6
报告期内偏离度的最高值	0.1400%
报告期内偏离度的最低值	-0.3352%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0938%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 本报告期内，本基金没有持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

8.8.3 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。

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,449,318.46
4	应收申购款	60,999,896.92
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	62,449,215.38

8.8.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
9456	50,173.74	355,884,092.47	75.01%	118,558,825.66	24.99%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	203,924.62	0.0430%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005 年 11 月 10 日）基金份额总额	4,643,264,492.55
本报告期期初基金份额总额	2,862,765,943.23
本报告期基金总申购份额	2,783,842,660.14
减：本报告期基金总赎回份额	5,172,165,685.24
本报告期期末基金份额总额	474,442,918.13

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经本基金管理人 2010 年度第一次股东会会议决议，同意黄金源（NG Kim Guan）先生、何国良（Patrick HO）先生、马军先生辞去我公司董事职务，同时聘任孙泉先生、雷柏刚先生（Robert Allen Cook）、施德林先生（Marc Howard Sterling）、王裕闵（Yu-Ming Wang）先生担任公司董事。具体内容请参考本基金管理人于 2010 年 3 月 31 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于董事变更的公告》。

2、本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本年度无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本年度本基金无投资策略的变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用为 8 万元，该审计机构对本基金提供审计服务的年限为 5 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本年度基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有发生受到监管部门稽查或处罚的任何情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：交易席位选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- (1) 经营规范，有较完备的内控制度；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要
- (3) 能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中银国际	-	-	964,800,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期内，本货币市场基金未出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《泰达荷银基金管理有限公司关于股权变更及公司更名的公	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网	2010 年 3 月 9 日

	告》	站	
2	《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》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2010 年 3 月 17 日
3	《泰达宏利基金管理有限公司关于董事变更的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2010 年 3 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

我公司已于 2010 年 3 月 9 日发布《泰达荷银基金管理有限公司关于股权变更及公司更名的公告》，原公司外方股东荷银投资管理（亚洲）有限公司将所持有的泰达荷银基金管理有限公司全部 49% 的股权转让给宏利资产管理（香港）有限公司。变更后的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%。

同时公司名称由“泰达荷银基金管理有限公司”变更为“泰达宏利基金管理有限公司”。

经基金托管人同意，并报请中国证监会批准，我公司已于 2010 年 3 月 17 日发布《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》，本基金的名称也将改为泰达宏利货币市场基金。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 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和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所

13.3 查阅方式

基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也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》）或登陆本基金管理人互联网网址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达宏利基金管理有限公司：客户服务中心电话：400-698-8888（免长话费）或 010-66555662 网址：<http://www.mfcteda.com>

泰达宏利基金管理有限公司
2011 年 3 月 29 日