

泰达宏利京元宝货币市场基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：北京银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 27 日

§ 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。

基金托管人北京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（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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------------|------------------------|
| 基金简称 | 泰达宏利京元宝货币 | |
| 基金主代码 | 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 | |
| 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 10, 103, 854, 331. 45 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 | 357, 447, 850. 61 份 | 9, 746, 406, 480. 84 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 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。 |

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 | 北京银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 袁静 | 刘晔 |
| | 联系电话 | 010-66577513 | 010-66223695 |
| | 电子邮箱 | irm@mfcteda.com | liuyel@bankofbeijing.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-698-8888 | 95526 |
| 传真 | | 010-66577666 | 010-66226045 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.mfcteda.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

§ 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 11 月 23 日(基金合同生 效日)-2016 年 12 月 31 日 | |
|------------------------------|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|--|-----------------|
| | 泰达宏利京元 宝货币 A | 泰达宏利京元宝货 币 B | 泰达宏利京元 宝货币 A | 泰达宏利京元宝货 币 B | 泰达宏利京元 宝货币 A | 泰达宏利京元 宝货币 B |
| 本期 已实 现收 益 | 18,642,001.55 | 416,424,305.56 | 919,858.94 | 382,076,611.16 | 159,668.32 | 325,397.47 |
| 本期 利润 | 18,642,001.55 | 416,424,305.56 | 919,858.94 | 382,076,611.16 | 159,668.32 | 325,397.47 |
| 本期 净值 收益 率 | 3.6687% | 3.9170% | 4.0740% | 4.3248% | 0.2773% | 0.3042% |
| 3.1.2 期末 数据 和指 标 | 2018 年末 | | 2017 年末 | | 2016 年末 | |
| | 泰达宏利京元 宝货币 A | 泰达宏利京元宝货 币 B | 泰达宏利京元 宝货币 A | 泰达宏利京元宝货 币 B | 泰达宏利京元 宝货币 A | 泰达宏利京元 宝货币 B |
| 期末 基金 资产 净值 | 357,447,850.61 | 9,746,406,480.84 | 45,431,784.77 | 12,867,338,948.51 | 39,742,773.23 | 344,869,969.51 |
| 期末 基金 份额 净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |

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. 本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

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

泰达宏利京元宝货币 A

| 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 | 0.7122% | 0.0014% | 0.3403% | 0.0000% | 0.3719% | 0.0014% |
| 过去六个月 | 1.5384% | 0.0015% | 0.6805% | 0.0000% | 0.8579% | 0.0015% |
| 过去一年 | 3.6687% | 0.0020% | 1.3500% | 0.0000% | 2.3187% | 0.0020% |
| 自基金合同 生效起至今 | 8.1912% | 0.0019% | 2.8442% | 0.0000% | 5.3470% | 0.0019% |

泰达宏利京元宝货币 B

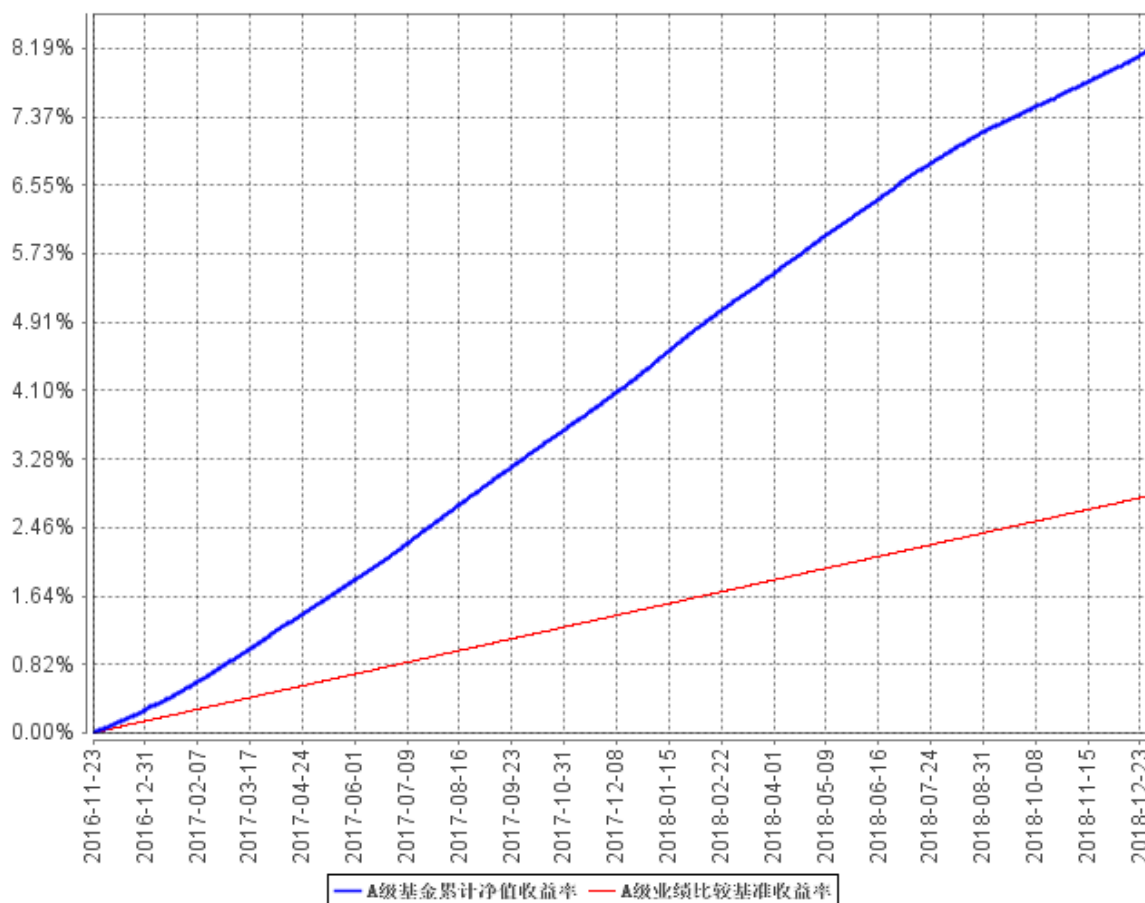
| 阶段 | 份额净值 收益率① | 份额净值 收益率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.7734% | 0.0014% | 0.3403% | 0.0000% | 0.4331% | 0.0014% |
| 过去六个月 | 1.6612% | 0.0015% | 0.6805% | 0.0000% | 0.9807% | 0.0015% |
| 过去一年 | 3.9170% | 0.0020% | 1.3500% | 0.0000% | 2.5670% | 0.0020% |
| 自基金合同 生效起至今 | 8.7410% | 0.0019% | 2.8442% | 0.0000% | 5.8968% | 0.0019% |

注：本基金的业绩比较基准：同期七天通知存款利率(税后)

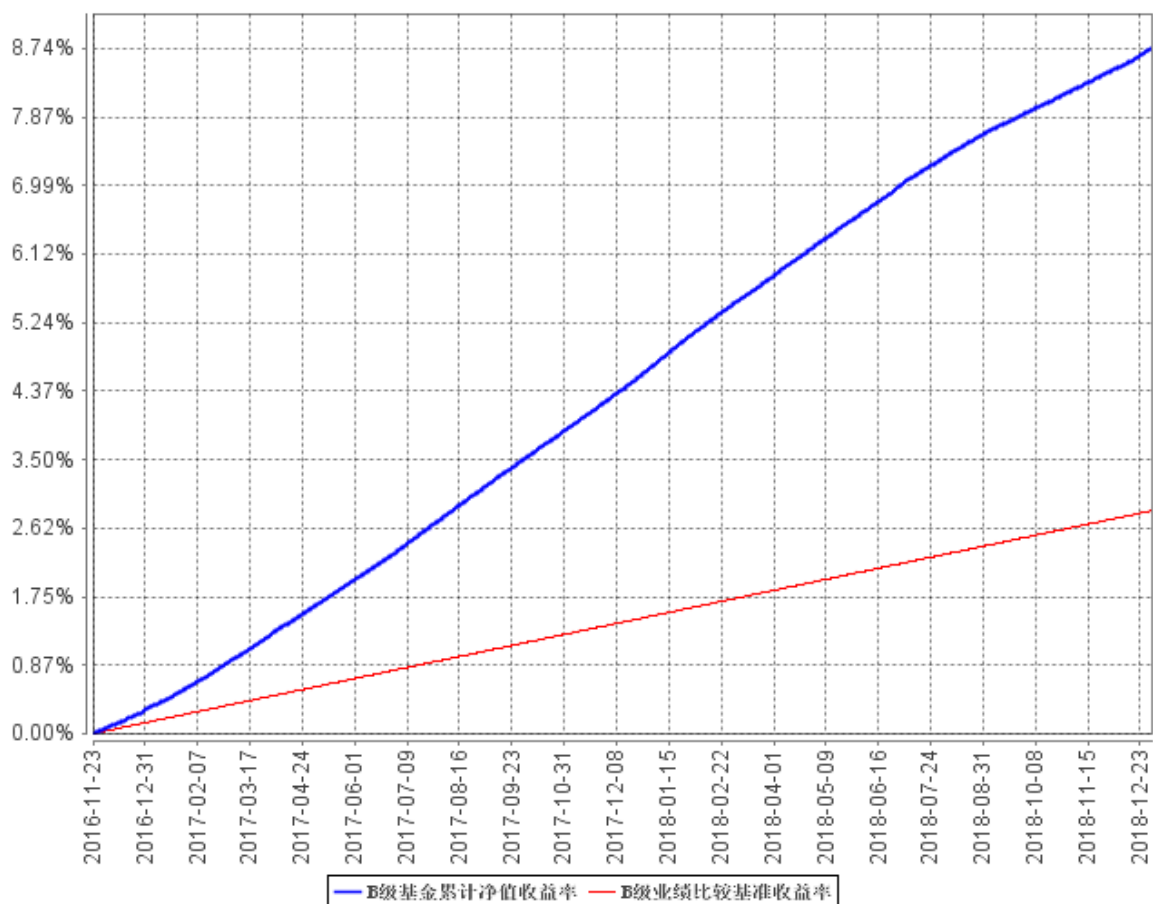
本基金定位为现金管理工具，注重基金资产的流动性和安全性，因此采用 7 天通知存款利率（税后）作为业绩比较基准。7 天通知存款利率由中国人民银行公布，如果 7 天通知存款利率或利息税发生调整，则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。

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

A级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



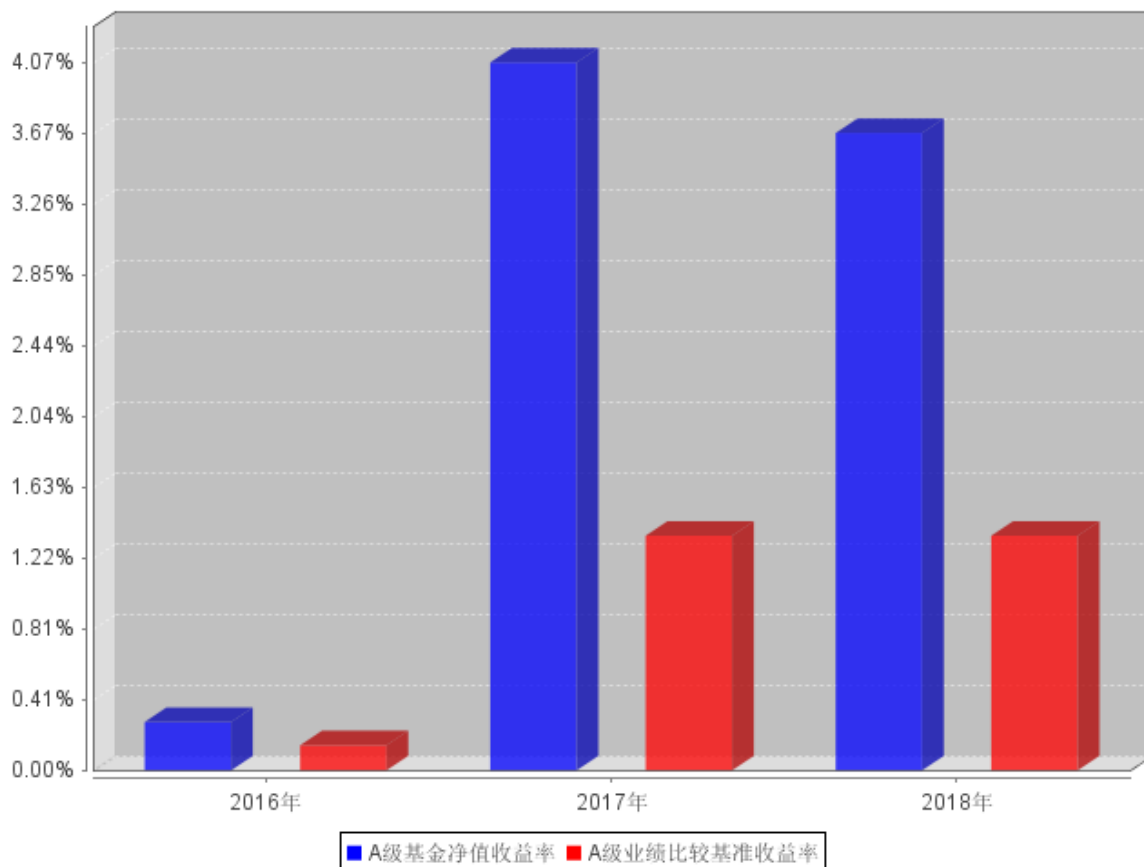
B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



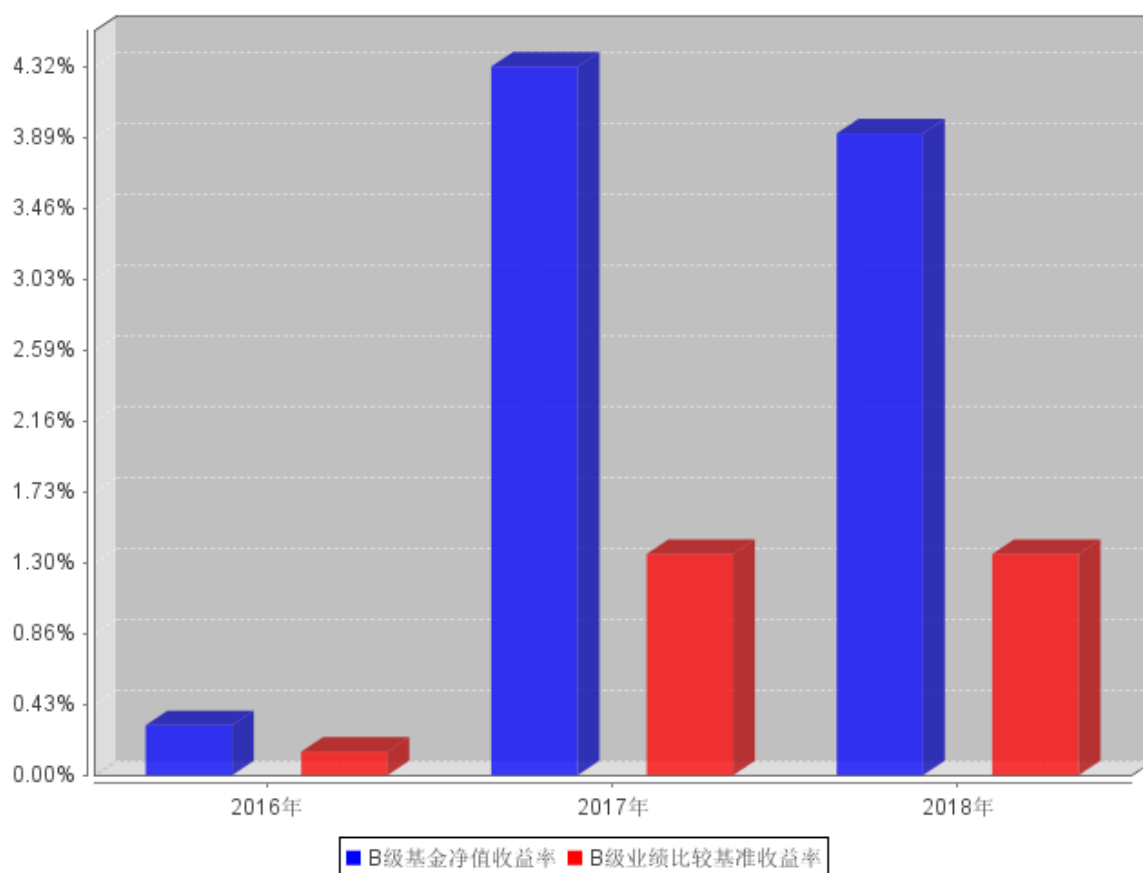
注：本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.3 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

A级自基金合同生效以来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



B级自基金合同生效以来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：本基金合同生效日为2016年11月23日，2016年度净值增长率的计算期间为2016年11月23日至2016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

| 泰达宏利京元宝货币 A | | | | | |
|-------------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 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 |
| 2018 | 18,522,830.61 | - | 119,170.94 | 18,642,001.55 | |
| 2017 | 912,538.19 | - | 7,320.75 | 919,858.94 | |
| 2016 | 150,511.90 | - | 9,156.42 | 159,668.32 | |
| 合计 | 19,585,880.70 | - | 135,648.11 | 19,721,528.81 | |

单位：人民币元

| 泰达宏利京元宝货币 B | | | | | |
|-------------|------------------|-----------------------|--------------|----------------|----|
| 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 |
| 2018 | 417,389,986.45 | - | -965,680.89 | 416,424,305.56 | |
| 2017 | 377,239,519.65 | - | 4,837,091.51 | 382,076,611.16 | |
| 2016 | 241,417.23 | - | 83,980.24 | 325,397.47 | |

| | | | | | |
|----|----------------|---|--------------|----------------|--|
| 合计 | 794,870,923.33 | - | 3,955,390.86 | 798,826,314.19 | |
|----|----------------|---|--------------|----------------|--|

§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：天津市泰达国际控股（集团）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、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利宏达混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)、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、泰达宏利

金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）在内的五十多只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资团队全体人员的共同努力，力求实现基金财产的持续增值。

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 | | |
| 丁宇佳 | 本基金基金经理 | 2016 年 11 月 23 日 | - | 10 | 中央财经大学理学学士；2008 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理、固定收益部总经理助理兼基金经理等职；具备 10 年基金从业经验，10 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。 |
| 王靖 | 本基金基金经理助理，固定收益部副总经理 | 2017 年 3 月 8 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 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；具备 11 年证券从业经验，具有基金从业资格。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程，严格执行相关制度规定。在投资管理活动中，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；在交易环节实行集中交易制度，交易部运用交易系统内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，确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，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。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）基金管理人管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，并向管理层报告。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同时间窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，无明显的非公平交易指令；基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

4.3.3 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。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。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 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

报告期内，美国经济在前三季度领跑全球，四季度出现增速拐点，但在流动性收缩的背景下，全球经济普遍呈现放缓趋势，金融市场风险偏好持续降低。而国内方面，全年央行货币政策保持宽松，宏观上金融数据率先出现较大幅度回落，经济数据在四季度出现加速下滑的端倪，经济下行压力近一步显现。

债券市场收益率一路下行，三季度受到宏观数据反弹以及地方债放量等因素影响有小幅反弹，总体全年呈现明显牛平格局，信用利差在年末也出现一定程度的收缩，但债券违约事件数量较前一年明显增加。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期泰达宏利京元宝货币 A 的基金份额净值收益率为 3.6687%，本报告期泰达宏利京元宝货币 B 的基金份额净值收益率为 3.9170%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

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 2019 年，经济下行压力较大，但宏观政策明显从去杠杆转向稳增长，将在一定程度上保证经济不出现失速风险。在流动性充裕的背景下，预计债券市场呈现震荡上涨的格局。由于资本利得空间较小，票息策略重新占据上风。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会主任由主管基金运营的副总经理担任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的利润分配方式为按日结转份额。根据相关法律法规及基金合同，本基金每日采用红利再投资的方式将各类基金份额的已实现收益全额分配给基金份额持有人。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 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

本报告期内，本基金托管人在托管泰达宏利京元宝货币市场基金（以下称“本基金”）的过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、收益分配情况、投资组合报告的内容（“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），保证复核内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§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(2019)第 23386 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 | 泰达宏利京元宝货币市场基金全体基金份额持有人： |
| 审计意见 | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰达宏利京元宝货币市场基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 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。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面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(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了泰达宏利京元宝货币市场基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泰达宏利京元宝货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>泰达宏利京元宝货币市场基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协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，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泰达宏利京元宝货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泰达</p> |

| | |
|------------------------|---|
| | <p>宏利京元宝货币市场基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰达宏利京元宝货币市场基金的财务报告过程。</p> |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对泰达宏利京元宝货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰达宏利京元宝货币市场基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价</p> |

| | | |
|-----------|---|-----|
| | 财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 | |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | |
| 注册会计师的姓名 | 单峰 | 庞伊君 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼 | |
| 审计报告日期 | 2019 年 3 月 26 日 | |

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利京元宝货币市场基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 2,053,386,538.59 | 7,207,014,729.52 |
| 结算备付金 | 1,818,181.82 | - |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 5,132,124,383.11 | 5,940,656,556.72 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 5,132,124,383.11 | 5,940,656,556.72 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 3,352,914,429.36 | 1,615,727,863.58 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 50,006,420.03 | 46,005,431.66 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 10,590,249,952.91 | 14,809,404,581.48 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 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 | 479,398,920.90 | 1,886,751,136.30 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 1,325,904.64 | 2,137,579.42 |
| 应付托管费 | 441,968.22 | 712,526.47 |
| 应付销售服务费 | 163,003.68 | 152,449.81 |
| 应付交易费用 | 205,456.92 | 200,043.24 |
| 应交税费 | 48,168.45 | - |
| 应付利息 | 282,159.68 | 1,627,564.04 |
| 应付利润 | 4,091,038.97 | 4,937,548.92 |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 439,000.00 | 115,000.00 |
| 负债合计 | 486,395,621.46 | 1,896,633,848.20 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 10,103,854,331.45 | 12,912,770,733.28 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 10,103,854,331.45 | 12,912,770,733.28 |
| 负债和所有者权益总计 | 10,590,249,952.91 | 14,809,404,581.48 |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 10,103,854,331.45 份。其中 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 357,447,850.61 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 9,746,406,480.84 份。

7.2 利润表

会计主体：泰达宏利京元宝货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | 482,601,105.92 | 416,055,965.55 |
| 1.利息收入 | 486,391,101.42 | 416,848,323.19 |
| 其中：存款利息收入 | 161,429,746.41 | 261,497,937.58 |
| 债券利息收入 | 205,440,425.93 | 102,561,865.46 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 119,520,929.08 | 52,788,520.15 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -3,789,995.50 | -792,357.64 |

| | | |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -3,789,995.50 | -792,357.64 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | - | - |
| 减：二、费用 | 47,534,798.81 | 33,059,495.45 |
| 1. 管理人报酬 | 17,255,280.81 | 13,137,517.36 |
| 2. 托管费 | 5,751,760.34 | 4,379,172.45 |
| 3. 销售服务费 | 2,402,992.13 | 929,527.67 |
| 4. 交易费用 | 1,767.90 | 10.89 |
| 5. 利息支出 | 21,546,589.16 | 14,414,159.43 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 21,546,589.16 | 14,414,159.43 |
| 6. 税金及附加 | 33,025.38 | - |
| 7. 其他费用 | 543,383.09 | 199,107.65 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 435,066,307.11 | 382,996,470.10 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 435,066,307.11 | 382,996,470.10 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利京元宝货币市场基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018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） | 12,912,770,733.28 | - | 12,912,770,733.28 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 435,066,307.11 | 435,066,307.11 |

| | | | |
|--|----------------------------------|-----------------|--------------------|
| 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） | -2,808,916,401.83 | - | -2,808,916,401.83 |
| 其中：1. 基金申购款 | 26,069,665,014.52 | - | 26,069,665,014.52 |
| 2. 基金赎回款 | -28,878,581,416.35 | - | -28,878,581,416.35 |
| 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） | - | -435,066,307.11 | -435,066,307.11 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 10,103,854,331.45 | - | 10,103,854,331.45 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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） | 384,612,742.74 | - | 384,612,742.74 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 382,996,470.10 | 382,996,470.10 |
| 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） | 12,528,157,990.54 | - | 12,528,157,990.54 |
| 其中：1. 基金申购款 | 34,736,432,660.62 | - | 34,736,432,660.62 |
| 2. 基金赎回款 | -22,208,274,670.08 | - | -22,208,274,670.08 |
| 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） | - | -382,996,470.10 | -382,996,470.10 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 12,912,770,733.28 | - | 12,912,770,733.28 |

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：

刘建

傅国庆

王泉

基金管理人负责人

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

泰达宏利京元宝货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称

“中国证监会”)证监许可[2016]2141号《关于准予泰达宏利京元宝货币市场基金注册的批复》核准,由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《泰达宏利京元宝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人民币200,652,912.54元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1505号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利京元宝货币市场基金基金合同》于2016年11月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,689,255.57份基金份额,其中认购资金利息折合36,343.03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,基金托管人为北京银行股份有限公司(以下简称“北京银行”)。

根据《泰达宏利京元宝货币市场基金基金合同》和《泰达宏利京元宝货币市场基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据投资者持有的基金份额数量级别将基金份额分为A类和B类,不同级别的基金份额适用不同费率的销售服务费;并根据投资者基金交易账户所持有份额数量是否不低于300万份进行不同级别基金份额的判断和处理。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利京元宝货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据和同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,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:同期七天通知存款税后利率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利京元宝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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度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2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 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 |
| 北京银行股份有限公司(“北京银行”) | 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(自 2006 年 4 月 21 日至 2018 年 12 月 17 日止) |
| 天津市泰达国际控股(集团)有限公司 | 基金管理人的股东(自 2018 年 12 月 18 日起) |
| 宏利资产管理(香港)有限公司 | 基金管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 |
|----|------------------------------|--|
| | | |

| | 12 月 31 日 | 31 日 |
|-----------------|---------------|---------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 17,255,280.81 | 13,137,517.36 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 485,033.06 | 28,010.16 |

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 0.15% 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 X 0.15% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,751,760.34 | 4,379,172.45 |

注：支付基金托管人北京银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 X 0.05% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|----------------------------------|--------------|--------------|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泰达宏利京元宝货币 A | 泰达宏利京元宝货币 B | 合计 |
| 泰达宏利基金管理有限公司 | 10,854.56 | 1,058,112.87 | 1,068,967.43 |
| 北京银行 | 9,038.38 | 97.90 | 9,136.28 |
| 合计 | 19,892.94 | 1,058,210.77 | 1,078,103.71 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泰达宏利京元宝货币 A | 泰达宏利京元宝货币 B | 合计 |
| 泰达宏利基金管理有限公司 | 2,832.26 | 868,848.77 | 871,681.03 |
| 北京银行 | - | - | - |
| 合计 | 2,832.26 | 868,848.77 | 871,681.03 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别基金资产净值的约定年费率计提，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。A 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 对应级别约定年费率 / 当年天数。

7.4.8.3 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 |
| 北京银行 | - | - | - | - | 20,938,050,000.00 | 1,661,547.67 |
| 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 |
| 北京银行 | - | - | - | - | 4,836,960,000.00 | 618,634.88 |

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用自有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.8.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 |
| | 北京银行 | 3,386,538.59 | 4,889,610.79 | 7,014,729.52 |

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，按约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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 479,398,920.90 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 |
|-----------|-------------------|-------------------|--------|-----------|----------------|
| 111807085 | 18 招商银行 CD085 | 2019 年 1 月 4 日 | 99.11 | 3,200,000 | 317,152,000.00 |
| 140408 | 14 农发 08 | 2019 年 1 月 4 日 | 100.37 | 810,000 | 81,299,700.00 |
| 111813047 | 18 浙商银 行 CD047 | 2019 年 1 月 4 日 | 99.49 | 1,120,000 | 111,428,800.00 |
| 合计 | | | | 5,130,000 | 509,880,500.00 |

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

7.4.10 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 5,132,124,383.11 元，无属于第一或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 5,940,656,556.72 元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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。

(2) 其他

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 | 5,132,124,383.11 | 48.46 |
| | 其中：债券 | 5,132,124,383.11 | 48.46 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 3,352,914,429.36 | 31.66 |
| | 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 | 2,055,204,720.41 | 19.41 |
| 4 | 其他各项资产 | 50,006,420.03 | 0.47 |
| 5 | 合计 | 10,590,249,952.91 | 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 | 6.59 | |
| | 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 | 479,398,920.90 | 4.74 |
| | 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

本基金本报告期末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。

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 | 57 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 64 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 18 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过 120 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 | 41.35 | 4.74 |
| | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 24.58 | - |

| | | | |
|---|------------------------|--------|------|
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 15.58 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—120 天 | 8.46 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天(含)—397 天(含) | 14.35 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 104.32 | 4.74 |

8.4 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。

8.5 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 | 19,983,006.91 | 0.20 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 500,589,179.14 | 4.95 |
| | 其中：政策性金融债 | 500,589,179.14 | 4.95 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 881,926,342.57 | 8.73 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 3,729,625,854.49 | 36.91 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 5,132,124,383.11 | 50.79 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

8.6 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

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 | 111807085 | 18 招商银行 CD085 | 4,000,000 | 396,455,135.34 | 3.92 |
| 2 | 011801685 | 18 华能水 | 2,000,000 | 200,249,139.59 | 1.98 |

| | | | | | |
|----|-----------|----------------|-----------|----------------|------|
| | | 电 SCP007 | | | |
| 3 | 111881449 | 18 天津银行 CD209 | 2,000,000 | 199,585,701.00 | 1.98 |
| 4 | 111814272 | 18 江苏银行 CD272 | 2,000,000 | 198,974,450.83 | 1.97 |
| 5 | 111813047 | 18 浙商银行 CD047 | 2,000,000 | 198,971,550.28 | 1.97 |
| 6 | 111813046 | 18 浙商银行 CD046 | 2,000,000 | 198,879,346.37 | 1.97 |
| 7 | 111883737 | 18 哈尔滨银行 CD134 | 2,000,000 | 198,858,532.62 | 1.97 |
| 8 | 111884905 | 18 苏州银行 CD085 | 2,000,000 | 198,540,755.20 | 1.97 |
| 9 | 140408 | 14 农发 08 | 1,800,000 | 180,665,921.82 | 1.79 |
| 10 | 111814241 | 18 江苏银行 CD241 | 1,500,000 | 149,442,271.79 | 1.48 |

8.7 “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 |
|------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1330% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0035% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0512% |

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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

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。

8.9.2 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，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.9.3 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 | 50,006,420.03 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 50,006,420.03 |

8.9.4 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。

§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

| 份额级别 | 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 |
| 泰达宏利京元宝货币 A | 67,409 | 5,302.67 | 2,836,183.42 | 0.79% | 354,611,667.19 | 99.21% |

| | | | | | | |
|-------------|--------|----------------|------------------|---------|----------------|-------|
| 泰达宏利京元宝货币 B | 35 | 278,468,756.60 | 9,746,406,480.84 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 67,444 | 149,811.02 | 9,749,242,664.26 | 96.49% | 354,611,667.19 | 3.51% |

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）；

2、截止本报告期末，本基金机构投资者占比较高，请投资者关注相关风险。

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份） | 占总份额比例 |
|----|-------|------------------|--------|
| 1 | 银行类 | 2,038,589,818.09 | 20.18% |
| 2 | 银行类 | 1,016,874,505.13 | 10.06% |
| 3 | 银行类 | 1,016,750,049.40 | 10.06% |
| 4 | 其他机构 | 914,541,099.91 | 9.05% |
| 5 | 银行类 | 613,038,895.30 | 6.07% |
| 6 | 券商类 | 517,005,055.62 | 5.12% |
| 7 | 银行类 | 501,369,189.03 | 4.96% |
| 8 | 银行类 | 302,466,626.84 | 2.99% |
| 9 | 银行类 | 302,443,533.09 | 2.99% |
| 10 | 银行类 | 300,439,046.30 | 2.97% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 泰达宏利京元宝货币 A | 438,214.29 | 0.1226% |
| | 泰达宏利京元宝货币 B | 0.00 | 0.0000% |

| | | | |
|--|----|------------|---------|
| | 合计 | 438,214.29 | 0.0043% |
|--|----|------------|---------|

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 泰达宏利京元宝货币 A | 10~50 |
| | 泰达宏利京元宝货币 B | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 泰达宏利京元宝货币 A | 0 |
| | 泰达宏利京元宝货币 B | 0 |
| | 合计 | 0 |

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 泰达宏利京元宝货币 A | 泰达宏利京元宝货币 B |
|---------------------------------|------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2016 年 11 月 23 日）基金份额总额 | 91,130,773.05 | 109,558,482.52 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 45,431,784.77 | 12,867,338,948.51 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 2,868,110,581.11 | 23,201,554,433.41 |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额 | 2,556,094,515.27 | 26,322,486,901.08 |
| 本报告期末基金份额总额 | 357,447,850.61 | 9,746,406,480.84 |

§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、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。

2、本公司于 2018 年 9 月 27 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》，聘任刘晓玲女士为公司副总经理。

3、本公司于 2018 年 11 月 10 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》，聘任聂志刚先生为公司督察长。

4、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内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(特殊普通合伙)审计费用为人民币 150,000.00 元，该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为 2 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

本报告期内，基金管理人、本基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 | |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：（一）本基金交易单元均为成立时新增，2018 年本基金无证券交易单元变动。

（二）交易单元选择的标准和程序

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单元，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 |
| 银河证券 | 23,462,920.26 | 100.00% | 1,776,000,000.00 | 100.00% | - | - |

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 | 20180124- 20180315 | 2,114,051,86 3.48 | 527,179,504. 58 | 2,139,862,17 9.03 | 501,369,189. 03 | 4.96 % |
| | 2 | 20180101- 20180919 | 3,700,477,01 1.21 | 94,462,710.3 8 | 3,794,939,72 1.59 | 0.00 | 0.00 % |
| | 3 | 20181211- 20181212 | 0.00 | 2,038,589,81 8.09 | - | 2,038,589,81 8.09 | 20.1 8% |
| | 4 | 20181218- 20181231 | 0.00 | 2,038,589,81 8.09 | - | 2,038,589,81 8.09 | 20.1 8% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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。</p> | | | | | | | |

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）以及相关基金合同和托管协议的有关规定，经与各基金托管人协商一致，并履行了必要程序，本基金管理人对本基金基金合同和托管协议进行修改。详情请见基金管理人 2018 年 3 月 24 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下 51 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》以及更新后的基金合同与托管协议。

2、本公司于 2018 年 12 月 22 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于股权变更的公告》，原公司中方股东北方国际信托股份有限公司将所持有的泰达宏利基金管理有限公司全部 51% 股权转让给天津市泰达国际控股（集团）有限公司。此次股权转让完成后，公司的注册资本保持不变，仍为人民币 1.8 亿元。

泰达宏利基金管理有限公司

2019 年 3 月 27 日