泰达宏利货币市场基金
2022年第4季度报告

2022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：2023年1月18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2023年01月16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2022年10月01日至2022年12月31日。

§2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	4,039,697,016.17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	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	2,704,600,430.61份	1,335,096,585.56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（2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 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	6,563,349.35	6,615,562.78
2.本期利润	6,563,349.35	6,615,562.78
3.期末基金资产净值	2,704,600,430.61	1,335,096,585.56

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 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	0.5048%	0.0013%	0.3781%	0.0000%	0.1267%	0.0013%
过去六个月	0.9609%	0.0013%	0.7562%	0.0000%	0.2047%	0.0013%
过去一年	2.0349%	0.0014%	1.5000%	0.0000%	0.5349%	0.0014%
过去三年	6.5886%	0.0016%	4.5041%	0.0000%	2.0845%	0.0016%
过去五年	13.6727%	0.0055%	7.5041%	0.0000%	6.1686%	0.0055%
自基金合同生效起至今	63.9553%	0.0063%	38.3705%	0.0022%	25.5848%	0.0041%

泰达宏利货币 B

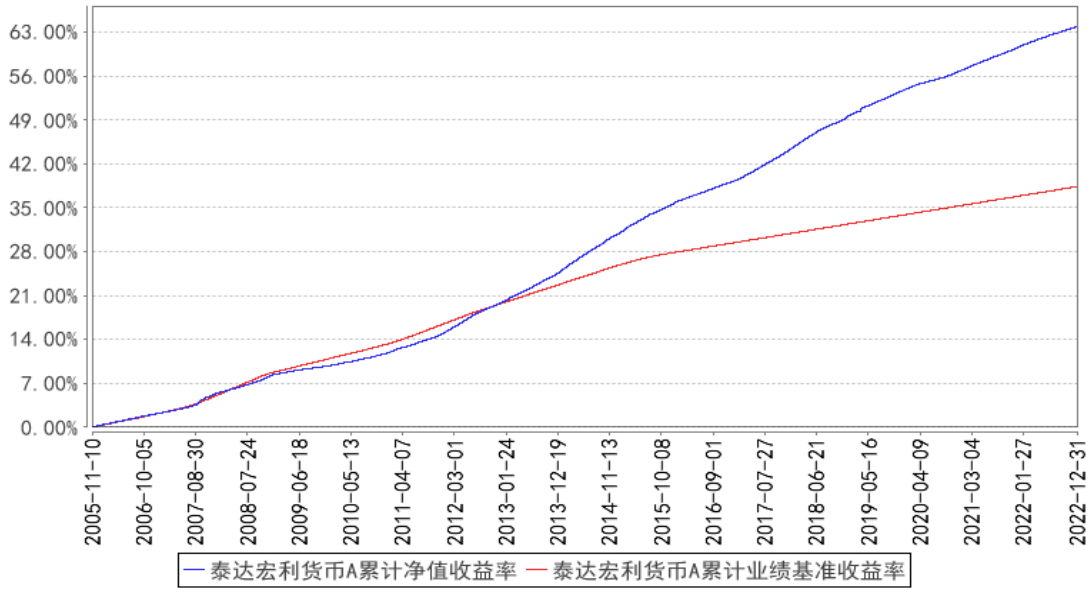
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.5218%	0.0014%	0.3781%	0.0000%	0.1437%	0.0014%
过去六个月	1.0392%	0.0013%	0.7562%	0.0000%	0.2830%	0.0013%
过去一年	2.2355%	0.0014%	1.5000%	0.0000%	0.7355%	0.0014%
过去三年	7.3123%	0.0016%	4.5041%	0.0000%	2.8082%	0.0016%
过去五年	14.9950%	0.0055%	7.5041%	0.0000%	7.4909%	0.0055%
自基金合同生效起至今	30.2054%	0.0059%	13.8137%	0.0011%	16.3917%	0.0048%

注：1、本基金的业绩比较基准：一年期银行定期存款利率(税后)。

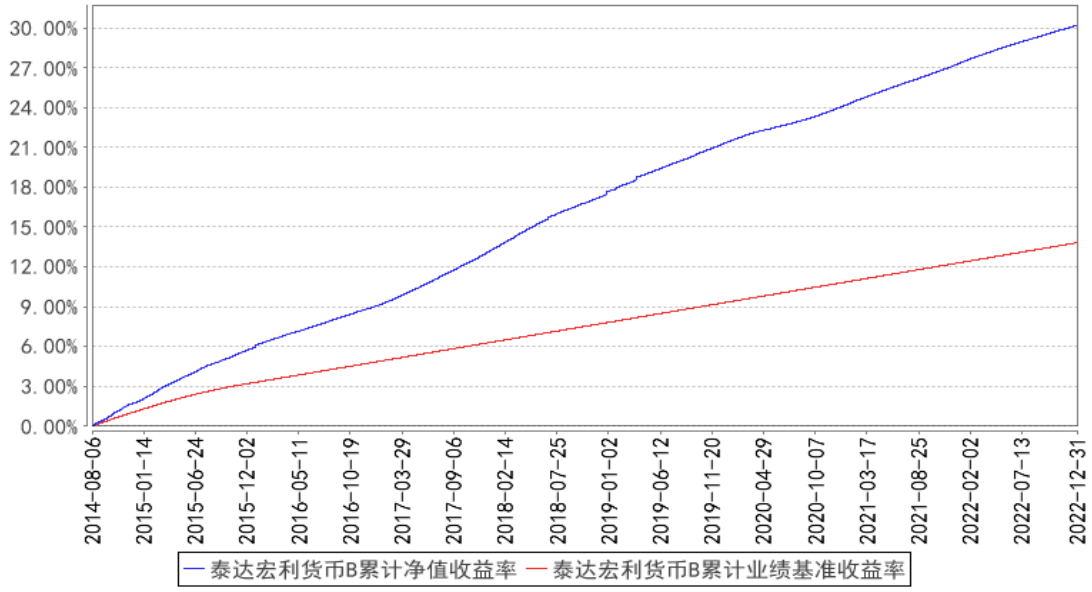
2、本报告期内，本基金收益分配原则为“每日分配、按日支付”。

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

泰达宏利货币A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



泰达宏利货币B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 A 类份额成立于 2005 年 11 月 10 日，B 类份额成立于 2014 年 8 月 6 日。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		
周丹娜	本基金基金经理	2022 年 4 月 11 日	-	8 年	毕业于法国里尔第二大学，国际金融分析专业，硕士研究生。自 2014 年 9 月起任

					职于泰达宏利基金管理有限公司，先后担任交易部助理交易员、交易员、交易主管、交易部总经理助理、固定收益部研究员，现任固定收益部基金经理。具备 8 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相关公告中披露的日期。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，10 月、11 月经济数据再度回落，疫情加剧、管控范围扩大导致生产、消费两侧收缩加剧，并推升就业压力。12 月中央经济会议部署扩大内需，改善地产行业资产负债状况，努力实现经济发展主要预期目标。防疫、地产两大支撑前期债市表现的因素随着近期政策层面出现的变化而有所转向，但需关注的是防疫政策变化过程中面临的波折，工业生产有望较快恢复，但消费复苏或将呈现“波折渐进”，难以“V 型”反弹。全球经济景气度持续回落，经济衰退风险进

一步加剧，欧美加息速度放缓。四季度整体收益率水平呈上行趋势，11月中旬面临剧烈波动，央行通过小幅降准及公开市场操作对流动性进行呵护，但资金成本及短端债券收益率仍有明显抬升。

本基金报告期内积极调整货币资产配置结构，灵活控制组合杠杆比率，为投资者提供了相对稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期泰达宏利货币A的基金份额净值收益率为0.5048%，本报告期泰达宏利货币B的基金份额净值收益率为0.5218%，同期业绩基准收益率为0.3781%。

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	1,601,812,513.20	39.64
	其中：债券	1,601,812,513.20	39.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,294,798,794.40	32.04
	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	965,107,578.74	23.88
4	其他资产	179,641,926.88	4.45
5	合计	4,041,360,813.22	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	5.07	
	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：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	46
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

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	37.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	31.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	18.04	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	1.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	6.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		96.34	-

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	59,938,593.62	1.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	143,667,731.00	3.56
	其中：政策性金融债	143,667,731.00	3.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	214,169,127.49	5.30

6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,184,037,061.09	29.31
8	其他	-	-
9	合计	1,601,812,513.20	39.65
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名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	112218007	22 华夏银行 CD007	1,000,000	99,689,075.10	2.47
2	112209025	22 浦发银行 CD025	700,000	69,798,638.32	1.73
3	112220029	22 广发银行 CD029	700,000	69,717,377.76	1.73
4	229958	22 贴现国债 58	600,000	59,938,593.62	1.48
5	220201	22 国开 01	500,000	51,009,096.61	1.26
6	112206042	22 交通银行 CD042	500,000	49,848,681.59	1.23
7	112218016	22 华夏银行 CD016	500,000	49,827,685.41	1.23
8	112206055	22 交通银行 CD055	500,000	49,826,147.12	1.23
8	112210065	22 兴业银行 CD065	500,000	49,826,147.12	1.23
10	112204003	22 中国银行 CD003	500,000	49,801,994.83	1.23

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	0.1885%
报告期内偏离度的最低值	-0.0004%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0741%

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 报告期末按摊余成本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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，浦发银行于2022年3月21日曾受到银保监会公开处罚，于2022年9月2日曾受到国家外汇管理局上海市分局公开处罚，于2022年8月17日曾受到上海市市场监管局公开处罚；广发银行于2022年3月21日曾受到银保监会公开处罚，于2022年8月31日曾受到央行公开处罚；国家开发银行于2022年3月21日曾受到银保监会公开处罚；交通银行于2022年3月21日、2022年9月9日曾受到银保监会的公开处罚；兴业银行于2022年3月21日、2022年9月9日、2022年9月28日曾受到银保监会公开处罚；中国银行于2022年3月21日、2022年5月26日曾受到银保监会公开处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	39,426,115.29
3	应收利息	-
4	应收申购款	140,215,811.59
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	179,641,926.88

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	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
报告期期初基金份额总额	314,444,644.65	1,119,027,706.18

报告期期间基金总申购份额	4,136,890,257.78	1,882,575,101.32
报告期期间基金总赎回份额	1,746,734,471.82	1,666,506,221.94
报告期期末基金份额总额	2,704,600,430.61	1,335,096,585.56

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2022-12-09	58,000,000.00	58,000,000.00	-
合计			58,000,000.00	58,000,000.00	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准泰达宏利货币市场基金设立的文件；

2、《泰达宏利货币市场基金基金合同》；

3、《泰达宏利货币市场基金招募说明书》；

4、《泰达宏利货币市场基金托管协议》；

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。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资人可登录中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）或者基金管理人互联网网站（http://www.mfcteda.com）查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2023年1月18日