

# 泰达宏利货币市场基金 2014 年年度报告

2014 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

送出日期：2015 年 3 月 27 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 2015 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 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |            |
|--|------------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>   |
| 1.1 重要提示.....                                | 2          |
| 1.2 目录.....                                  | 3          |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>   |
| 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          |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>6</b>   |
| 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 其他指标.....                                | 错误! 未定义书签。 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 11         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>12</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 12         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 14         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 14         |
| 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.....             | 15         |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 17         |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 17         |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 18         |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 18         |
| 4.9 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.....       | 18         |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>18</b>  |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 18         |
| 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..... | 19         |
| 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.....      | 19         |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>19</b>  |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 19         |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 19         |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>20</b>  |
| 7.1 资产负债表.....                               | 20         |
| 7.2 利润表.....                                 | 21         |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 22         |
| 7.4 报表附注.....                                | 24         |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>46</b>  |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 46         |
| 8.2 债券回购融资情况.....                            | 46         |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限.....                        | 47         |
| 8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 48         |
| 8.5 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.....      | 49         |
| 8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....          | 49         |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 49        |
| 8.8 投资组合报告附注 .....                          | 49        |
| <b>§9 基金份额持有人信息.....</b>                    | <b>50</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 50        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 51        |
| 9.3 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 .....     | 51        |
| <b>§10 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>51</b> |
| <b>§11 重大事件揭示.....</b>                      | <b>52</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 52        |
| 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 .....      | 52        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 52        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 52        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 52        |
| 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 .....         | 52        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 53        |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....                | 53        |
| 11.9 其他重大事件 .....                           | 53        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>              | <b>54</b> |
| <b>§13 备查文件目录.....</b>                      | <b>54</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 54        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 54        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 54        |

## § 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      | 795,425,198.26 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 | 251,294,109.86 份 | 544,131,088.40 份 |

### 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 | 本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。   |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期收益率和预期风险均低于股票、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   | 陈沛                         | 林葛                           |
|         | 联系电话 | 010-66577808               | 010-66060069                 |
|         | 电子邮箱 | irm@mfcteda.com            | tgxxpl@abchina.com           |
| 客户服务电话  |      | 400-69-88888               | 95599                        |
| 传真      |      | 010-66577666               | 010-68121816                 |
| 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 号英蓝国际金融中心南楼三层 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |

|       |        |        |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码  | 100033 | 100031 |
| 法定代表人 | 弓劲梅    | 刘士余    |

## 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(特殊普通合伙) | 中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6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 | 2014 年        |               | 2013 年        |          | 2012 年        |          |
|---------------|---------------|---------------|---------------|----------|---------------|----------|
|               | 泰达宏利货币 A      | 泰达宏利货币 B      | 泰达宏利货币 A      | 泰达宏利货币 B | 泰达宏利货币 A      | 泰达宏利货币 B |
| 本期已实现收益       | 26,380,481.61 | 19,470,113.08 | 18,155,806.25 | -        | 19,292,879.00 | -        |
| 本期利润          | 26,380,481.61 | 19,470,113.08 | 18,155,806.25 | -        | 19,292,879.00 | -        |
| 本期净值收益率       | 4.7686%       | 1.8775%       | 4.0442%       | -        | 4.1688%       | -        |
| 3.1.2 期末数据    | 2014 年末       |               | 2013 年末       |          | 2012 年末       |          |

|              |                |                |                |   |                |   |
|--------------|----------------|----------------|----------------|---|----------------|---|
| 和指标          |                |                |                |   |                |   |
| 期末基金资产净值     | 251,294,109.86 | 544,131,088.40 | 156,736,411.87 | - | 311,758,605.18 | - |
| 期末基金份额净值     | 1.00           | 1.00           | 1.00           | - | 1.00           | - |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2014 年末        |                | 2013 年末        |   | 2012 年末        |   |
| 累计净值收益率      | 30.7133%       | 1.8775%        | 24.7643%       | - | 19.9149%       | - |

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. 本基金收益分配按月结转份额；

4. 货币 B 成立于 2014 年 8 月 6 日，详见《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利货币市场基金实施份额分类并修改基金合同、招募说明书和托管协议的公告》。

### 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         | 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      | 1.0761%  | 0.0095%     | 0.7288%    | 0.0003%       | 0.3473% | 0.0092% |
| 过去六个月      | 2.1916%  | 0.0078%     | 1.4849%    | 0.0003%       | 0.7067% | 0.0075% |
| 过去一年       | 4.7686%  | 0.0074%     | 2.9726%    | 0.0002%       | 1.7960% | 0.0072% |
| 过去三年       | 13.5492% | 0.0077%     | 9.2178%    | 0.0005%       | 4.3314% | 0.0072% |
| 过去五年       | 19.0534% | 0.0070%     | 14.8021%   | 0.0011%       | 4.2513% | 0.0059% |
| 自基金合同生效起至今 | 30.7133% | 0.0069%     | 25.7459%   | 0.0018%       | 4.9674% | 0.0051% |

泰达宏利货币 B

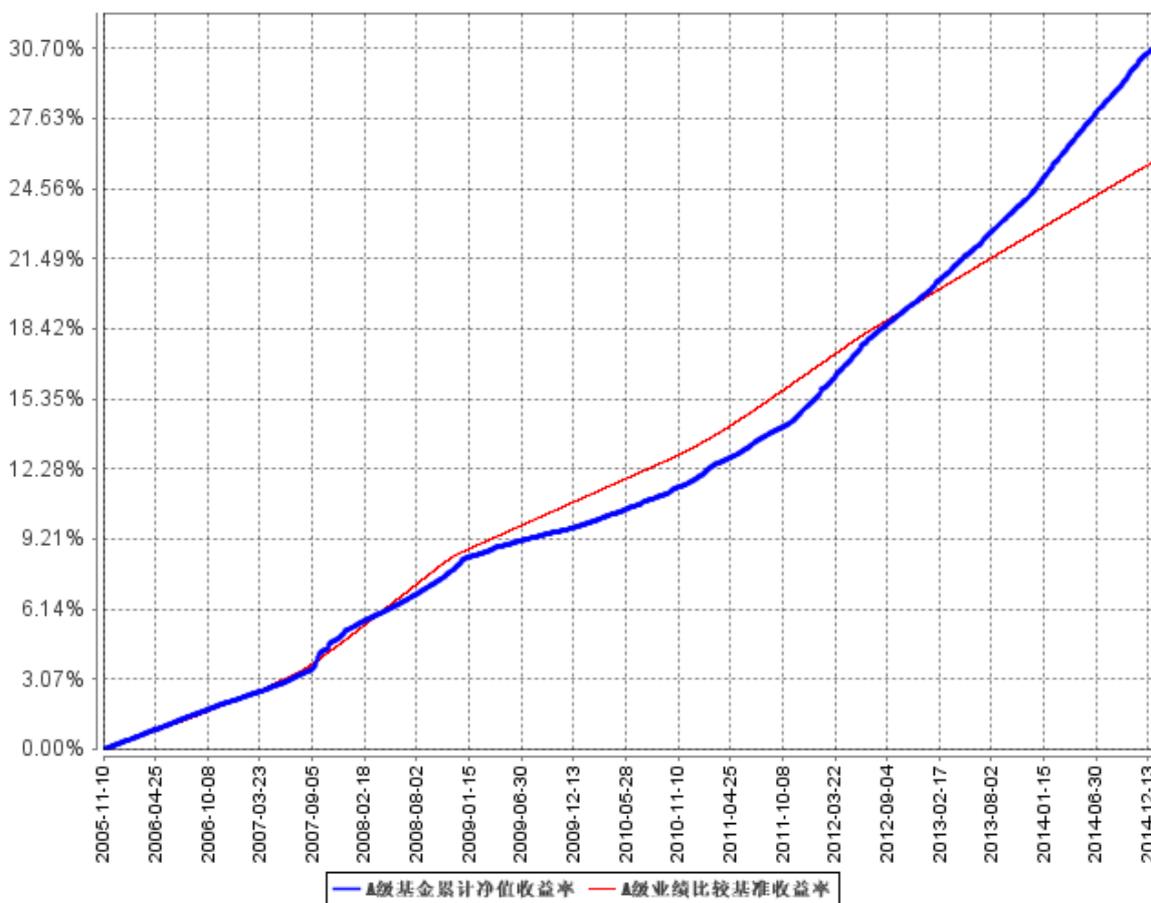
| 阶段    | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④     |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 1.1370%  | 0.0095%     | 0.7288%    | 0.0003%       | 0.4082% | 0.0092% |

|            |         |         |         |         |         |         |
|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 自基金合同生效起至今 | 1.8775% | 0.0083% | 1.1890% | 0.0003% | 0.6885% | 0.0080% |
|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|

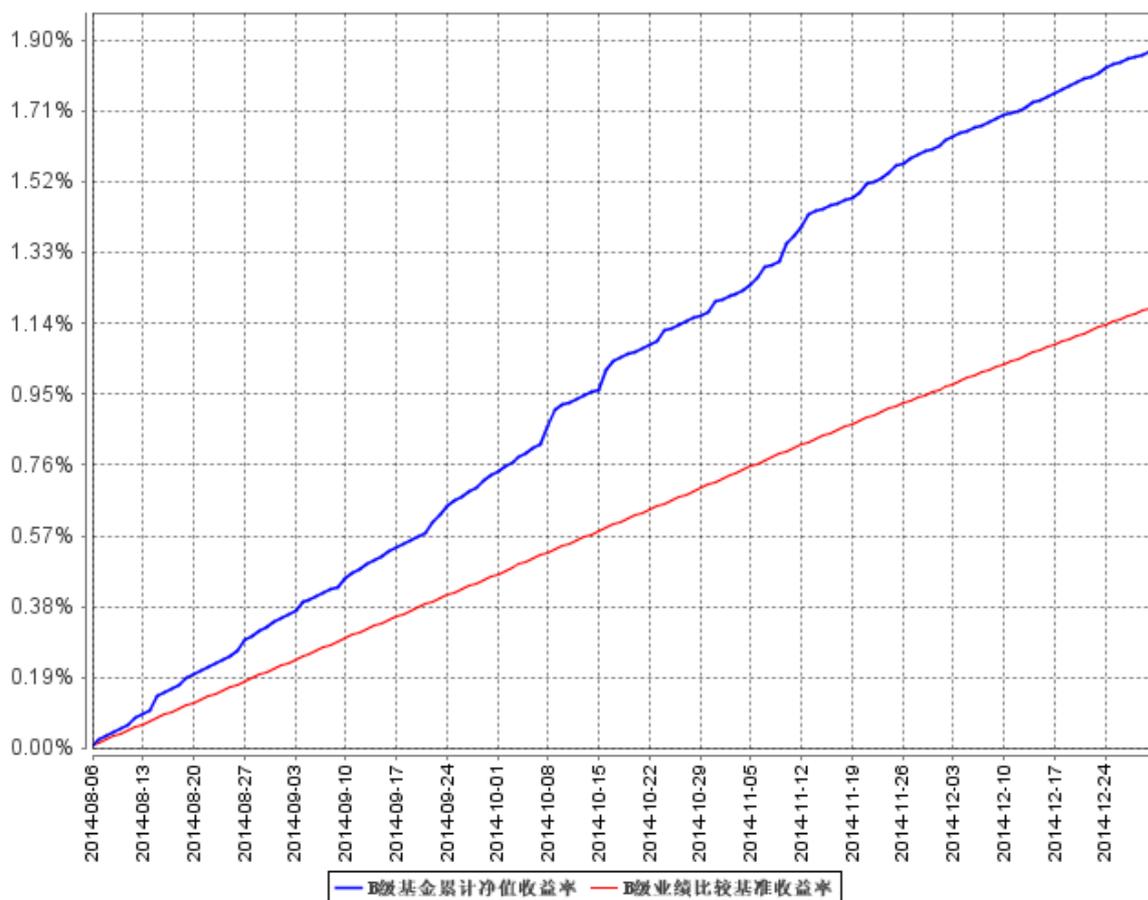
1. 本基金收益分配按月结转份额。
2. 本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。

### 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**



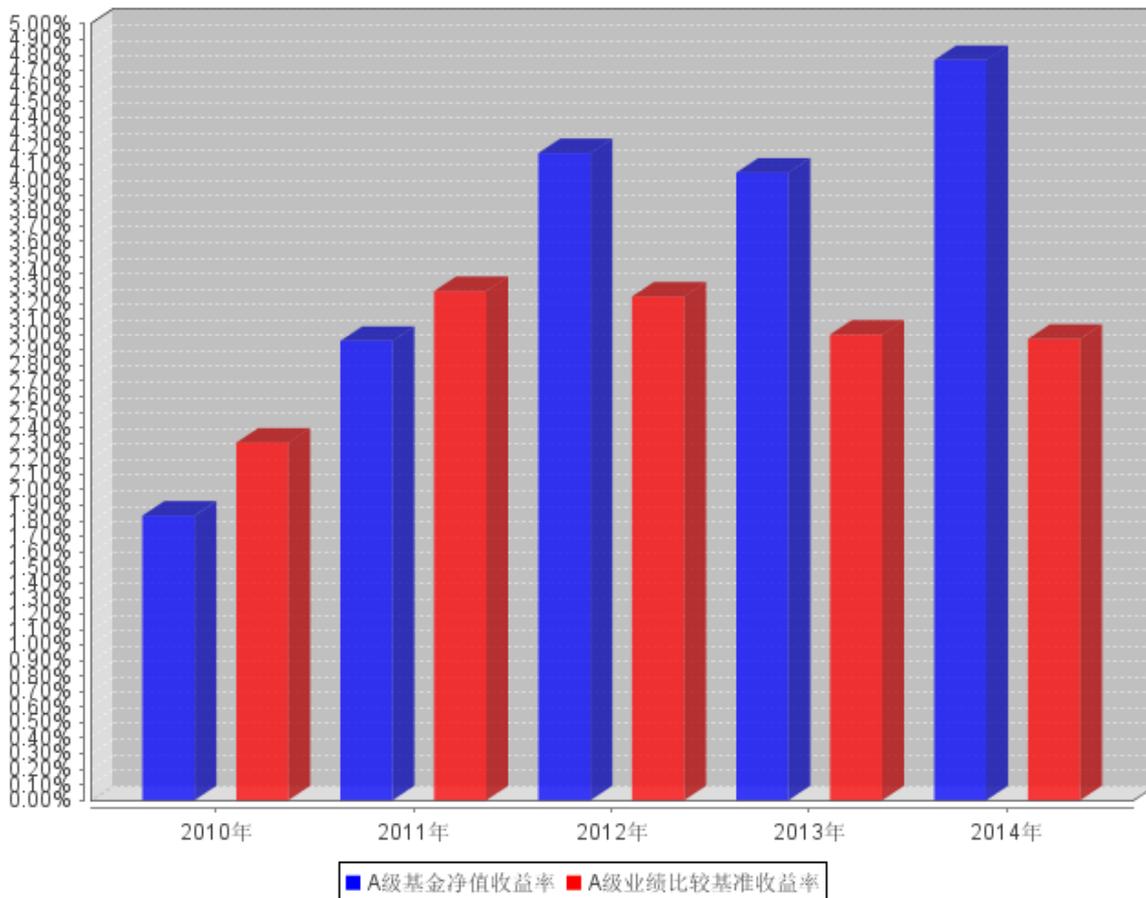
**B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



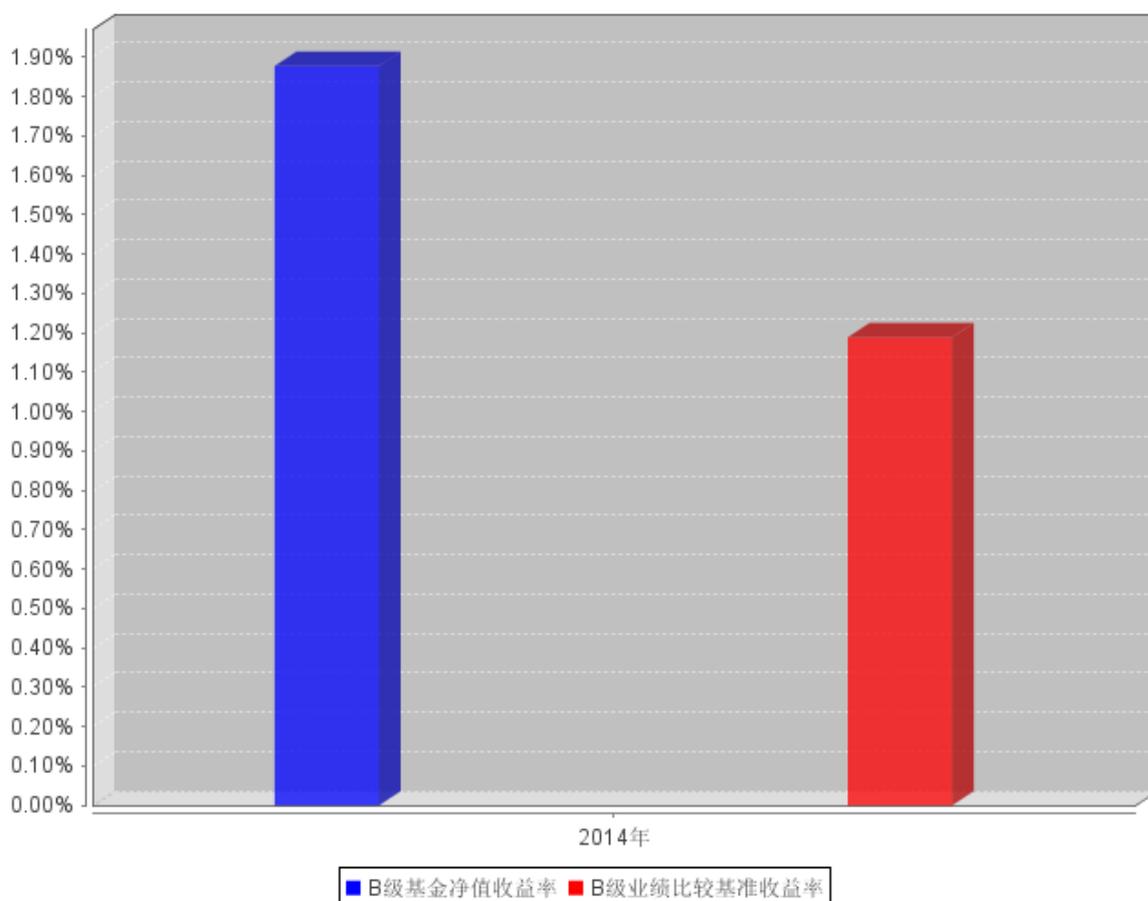
本基金成立于 2005 年 11 月 10 日，在建仓期结束时及截止报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 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

**A级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**



**B级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**



货币 B 份额成立于 2014 年 8 月 6 日，2014 年度净值增长率的计算期间为 2014 年 8 月 6 日至 2014 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

| 泰达宏利货币 A |                  |                   |              |               |    |
|----------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 年度       | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计  | 备注 |
| 2014     | 20,512,043.44    | 5,917,947.41      | -49,509.24   | 26,380,481.61 |    |
| 2013     | 15,728,266.98    | 2,924,565.98      | -497,026.71  | 18,155,806.25 |    |
| 2012     | 13,910,722.29    | 4,593,560.04      | 788,596.67   | 19,292,879.00 |    |
| 合计       | 50,151,032.71    | 13,436,073.43     | 242,060.72   | 63,829,166.86 |    |

单位：人民币元

| 泰达宏利货币 B |                  |                   |              |               |    |
|----------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 年度       | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计  | 备注 |
| 2014     | 16,142,291.46    | 2,353,931.05      | 973,890.57   | 19,470,113.08 |    |
| 合计       | 16,142,291.46    | 2,353,931.05      | 973,890.57   | 19,470,113.08 |    |

注：货币 B 成立于 2014 年 8 月 6 日，详见《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利货币市场基金实施份额分类并修改基金合同、招募说明书和托管协议的公告》。

## § 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证券投资基金、泰达宏利行业精选证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场证券投资基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选股票型证券投资基金、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、泰达宏利红利先锋股票型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、泰达宏利全球新格局证券投资基金、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金、泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型基金、泰达宏利养老收益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在内的二十多只证券投资基金。

#### 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  | -    | 12     | 金融学硕士；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 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>与研究<br/>工作，首席<br/>研究员；<br/>2006 年 3<br/>月至 2006<br/>年 6 月就<br/>职于国联<br/>证 券 公<br/>司，从事<br/>债券交易<br/>工作，高<br/>级经理；<br/>2006 年 7<br/>月至 2008<br/>年 3 月就<br/>职于益民<br/>基金管理<br/>有 限 公<br/>司，其中<br/>2006 年 7<br/>月至 2006<br/>年 11 月任<br/>益民货币<br/>市场基金<br/>基金经理<br/>助 理 ，<br/>2006 年<br/>12 月 至<br/>2008 年 3<br/>月任<br/>益民货币<br/>市场基金<br/>基 金 经<br/>理；2008<br/>年 4 月加<br/>盟泰达宏<br/>利基金管<br/>理有限公司。<br/>12 年<br/>证券从业<br/>经验，9<br/>年基金从<br/>业经验，<br/>具有基金<br/>从 业 资</p> |
|--|--|--|--|--|--|

|     |         |                 |   |   |  |
|-----|---------|-----------------|---|---|--|
|     |         |                 |   |   | 格。   |
| 丁宇佳 | 本基金基金助理 | 2014 年 9 月 17 日 | - | 6 | 中央财经大学理学学士学位；2008 年 7 月至今任职于泰达宏利基金管理有限公司，历任交易部交易员、固定收益部研究员，目前担任泰达宏利货币市场基金基金经理助理。 |

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、本基金合同和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 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、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，并经公司管理层审核签署后存档备查。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，未发现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，风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估，定期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。如发现疑似异常交易情况，相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。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，本基金管理人管理的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%，没有发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为，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

2014 年上半年，欧美主要经济体经济增长较为稳健，耶伦正式就任美联储主席之后的 3 月美

联储会议毫无悬念继续 QE 退出，之后持续缩减 QE 规模。受 QE 退出影响，新兴市场国家流动性受到较大冲击，人民币对美元贬值幅度较大，大量热钱外逃。2014 年 3 季度，美国经济有所反复，但总体复苏趋势较为确定，人民币对美元的贬值在 6 月份到达高点，之后人民币逐步走强，但外汇占款流入并不明显，对国内流动性管理提出新的挑战。

国内经济方面，让人意外的是中国经济没能持续 13 年 3 季度以来的回升态势，14 年上半年前期表现较差。3 月中下旬以来，中央政府由于经济下滑启动了一些稳增长的举措，在政府微刺激作用下，5、6 月份部分先行指标开始出现企稳迹象。3 季度末中国经济重新开始走弱。物价方面，受原油等大宗商品价格持续回落影响，国内 PPI 跌至-2%以下，猪周期表现并不明显，CPI 逆季节性进入下行通道。

央行的态度在 13 年底开始发生微妙改变，春节前更是推出了地方版的 SLO，明确提出了地方版 SLO 的触发条件，对稳定货币市场预期起到了很好的作用。春节后尽管央行重启了正回购，2 月底时也通过 SLO 等方式回笼大量资金，但春节后，货币市场利率维持在低位，银行间 1 天回购利率较长时间维持在 2%以内，甚至 1 季度末资金看似较为紧张的时点，银行间隔夜利率依然只是维持 3%附近。尽管一直宣称货币政策不会发生改变，进入 2 季度之后货币政策实际转向中性偏宽松越来越明确。进入 5 月份以后，通过缩减正回购发行量，公开市场常态性的向市场注入资金，5 月 10 日以来，央行已经持续向市场投放资金。4 月和 6 月，央行更是 2 次宣布定向降准。尽管上半年人民币大幅贬值导致大量热钱外逃，在央行的悉心呵护之下，市场资金面较为宽裕，没有再现 2013 年 6 月资金紧张的情况，甚至在 6 月末的时候银行间 1 天回购还维持在 3%以下的较低位置。3 季度央行多次定向降息、降准，并于 11 月进行不对称降息。但随后受到同业存款缴准传言、股票 IPO 和股市上涨的挤压效应影响，银行间流动性明显紧张，但央行公开市场零操作，12 月到期 MLF 仅续作一半，叠加 12 月中债登关于地方政府债务清理的新规进一步挤压资金面，银行间回购利率达到今年 2 月以来高点。

受益于流动性宽松和一系列金融监管政策的出台，11 月之前货币市场各个品种收益率保持一路向下的趋势。但中低等级信用债分化较为严重，部分资质较差中低等级债券面临融资成本上升的压力。6、7 月份债券市场经历了短暂的调整，但之后重新走出新一轮牛市。10 月，中长期利率债收益率创出年内新低，中高等级信用债收益率创年内新低，信用利差创年内新低。然而 11 月之后，受流动性冲击，信用债收益率大幅上行，信用利差扩大，而期限利差压缩至低位，1 年内利率债、短期融资券均出现倒挂的情况。

操作上，本基金较为积极，对政策宽松持比较坚定的态度，尽管这是一个不断印证的过程。随着货币宽松情况不断确认，本基金增持较多的 1 年期附近短融和利率债，组合久期维持较高的

水平。在 11 月收益率创新低，并且和回购利率利差持续收窄之后，策略由积极转为谨慎，降低债券久期至中性水平，并配合较短久期的回购以及存款应对资金面冲击。12 月由于遭遇较大规模赎回，收益率受到影响。全年由于规模波动较大，本基金坚持低杠杆策略。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

##### 货币 A

截止报告期末，本基金份额净值为 1.0000 元，本报告期份额净值增长率为 4.7686%，同期业绩比较基准增长率为 2.9726%。

##### 货币 B

截止报告期末，本基金份额净值为 1.0000 元，自成立以来的份额净值增长率为 1.8775%，同期业绩比较基准增长率为 1.1890%。

#### 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 2015 年，预计美国经济有望继续走强，欧洲经济维持弱势，中国出口将较为稳定；通胀处于低位并面临一定通缩风险；国内经济维持低位徘徊，央行从宽货币到宽信用的调控方向较为明确，预计随着贷款增速提高，房地产销售和投资将有明显好转。随着外汇占款减少，央行货币政策将保持宽松，但难见进一步放松；资金面将受到 IPO 等干扰，波动幅度及频率都将有所增加。目前收益率曲线仍然非常平坦，短端债券利率反弹至目前的位置具有一定持有价值，目前看，优选资质较好的中低等级信用债仍然是较好选择。

#### 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、风险管理部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。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；在证券投资交易前由研究部门建立可供投资的基础库并定期进行全面维护更新和适时对个股进行维护更新，通过信息技术建立多级投资交易预警系统，并把禁选股票排除在交易系统之外；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；引入外方股东在风险控制方面的先进经验，完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司

经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司董事会及外部监管部门。

#### 4.7 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。公司估值委员会由主管运营的副总经理负责，成员包括督察长、投资总监、研究部、固定收益部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员，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。

#### 4.8 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 2014 年累计分配收益 45,850,594.69 元，已于每月中旬集中转结至基金持有人账户。

#### 4.9 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

自 2014 年 8 月 8 日至本报告期末，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

在托管泰达宏利货币市场基金的过程中，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《泰达宏利货币市场基金基金合同》、《泰达宏利货币市场基金托管协议》的约定，对泰达宏利货币市场基金基金管理人—泰达宏利基金管理公司 2014 年 1 月 1 日至 2014 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，未发现有关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(2015)第 20530 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 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 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 | 编制和公允列报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：<br><br>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；<br>(2) 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。 |
| 注册会计师的责任段    | 我们的责任是在执行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  |

|           |  |
|-----------|--|
|           | <p>工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行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。</p> <p>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，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。</p> <p>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> |
| 审计意见段     | 我们认为，上述泰达宏利货币市场基金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监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货币市场基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 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   王 珏  |
| 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)   |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼  |
| 审计报告日期    | 2015 年 3 月 27 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： 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2014 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款        | 7.4.7.1 | 110,294,767.65          | 39,241,990.30            |
| 结算备付金       |         | 465,000.00              | -                        |
| 存出保证金       |         | -                       | -                        |
| 交易性金融资产     | 7.4.7.2 | 753,761,181.94          | 79,665,626.34            |
| 其中：股票投资     |         | -                       | -                        |
| 基金投资        |         | -                       | -                        |
| 债券投资        |         | 753,761,181.94          | 79,665,626.34            |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产支持证券投资        |            | -                          | -                           |
| 贵金属投资           |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 47,800,281.70              | 50,100,395.15               |
| 应收证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 20,784,662.37              | 1,548,397.44                |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | 500.00                     | 909,159.87                  |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 933,106,393.66             | 171,465,569.10              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2014年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2013年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                            |                             |
| 短期借款            |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | 135,399,596.90             | 13,719,873.14               |
| 应付证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 424,238.90                 | 50,658.81                   |
| 应付托管费           |            | 128,557.25                 | 15,351.16                   |
| 应付销售服务费         |            | 82,160.76                  | 38,377.89                   |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 67,672.30                  | 9,682.06                    |
| 应交税费            |            | 51,309.84                  | 51,309.84                   |
| 应付利息            |            | 14,956.07                  | 1,266.28                    |
| 应付利润            |            | 1,415,573.38               | 491,192.05                  |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 97,130.00                  | 351,446.00                  |
| 负债合计            |            | 137,681,195.40             | 14,729,157.23               |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 795,425,198.26             | 156,736,411.87              |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | -                          | -                           |
| 所有者权益合计         |            | 795,425,198.26             | 156,736,411.87              |
| 负债和所有者权益总计      |            | 933,106,393.66             | 171,465,569.10              |

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额总额 795,425,198.26 份。其中 A 类基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 251,294,109.86 份；B 类基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 544,131,088.40 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰达宏利货币市场基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号        | 本期<br>2014年1月1日至2014<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至<br>2013年12月31日 |
|----------------------------|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |            | 54,036,163.36                   | 22,346,607.29                        |
| 1.利息收入                     |            | 43,392,075.50                   | 20,882,054.29                        |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11   | 5,458,291.03                    | 2,986,065.32                         |
| 债券利息收入                     |            | 25,372,373.05                   | 11,083,582.84                        |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -                               | -                                    |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 12,561,411.42                   | 6,812,406.13                         |
| 其他利息收入                     |            | -                               | -                                    |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |            | 10,644,087.86                   | 1,464,553.00                         |
| 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   | 10,644,087.86                   | 1,464,553.00                         |
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.13.5 | -                               | -                                    |
| 贵金属投资收益                    | 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   | -                               | -                                    |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 8,185,568.67                    | 4,190,801.04                         |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 3,385,368.01                    | 1,564,741.44                         |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 1,025,869.10                    | 474,164.11                           |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 1,520,345.56                    | 1,185,410.42                         |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | -                               | -                                    |
| 5. 利息支出                    |            | 1,767,747.33                    | 540,363.53                           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 1,767,747.33                    | 540,363.53                           |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 486,238.67                      | 426,121.54                           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 45,850,594.69                   | 18,155,806.25                        |
| 减：所得税费用                    |            | -                               | -                                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 45,850,594.69                   | 18,155,806.25                        |

### 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 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）                        | 156,736,411.87                              | -              | 156,736,411.87     |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 45,850,594.69  | 45,850,594.69      |
| 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）      | 638,688,786.39                              | -              | 638,688,786.39     |
| 其中：1. 基金申购款                            | 12,263,504,413.25                           | -              | 12,263,504,413.25  |
| 2. 基金赎回款                               | -11,624,815,626.86                          | -              | -11,624,815,626.86 |
| 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） | -   | -45,850,594.69 | -45,850,594.69     |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 795,425,198.26                              | -              | 795,425,198.26     |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 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）                        | 311,758,605.18                              | -              | 311,758,605.18     |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 18,155,806.25  | 18,155,806.25      |
| 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）      | -155,022,193.31                             | -              | -155,022,193.31    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 3,296,658,734.49                            | -              | 3,296,658,734.49   |
| 2. 基金赎回款                               | -3,451,680,927.80                           | -              | -3,451,680,927.80  |
| 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） | -   | -18,155,806.25 | -18,155,806.25     |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 156,736,411.87                              | -              | 156,736,411.87     |

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：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| _____    | _____     | _____   |
| 刘青山      | 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《关于泰达宏利货币市场基金实施份额分类修改基金合同、招募说明书和托管协议的公告》，自 2014 年 8 月 6 日起，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》、《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

和大量存单，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 2015 年 3 月 27 日批准报出。

## 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

本基金 2014 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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 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。

本基金目前以交易目的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其他各类应收款项等。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。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的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，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的账面价值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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额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。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

同一基金类别的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) 本基金的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，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

##### 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

##### 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[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[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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(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。

### 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<br>2014 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 294,767.65              | 241,990.30               |
| 定期存款           | 110,000,000.00          | 39,000,000.00            |
| 其中:存款期限 1-3 个月 | 110,000,000.00          | 14,000,000.00            |
| 其他期限定期存款       | -                       | 25,000,000.00            |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 合计:            | 110,294,767.65          | 39,241,990.30            |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

| 项目 |       | 本期末<br>2014 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 | 753,761,181.94           | 753,452,000.00 | -309,181.94 | -0.0389% |
|    | 合计    | 753,761,181.94           | 753,452,000.00 | -309,181.94 | -0.0389% |
| 项目 |       | 上年度末<br>2013 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 | 79,665,626.34            | 79,495,000.00  | -170,626.34 | -0.1089% |

|  |    |               |               |             |          |
|--|----|---------------|---------------|-------------|----------|
|  | 合计 | 79,665,626.34 | 79,495,000.00 | -170,626.34 | -0.1089% |
|--|----|---------------|---------------|-------------|----------|

注：

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

### 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<br>2014年12月31日  |           |
|-----------|---------------------|-----------|
|           | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所买入返售证券 | 20,000,000.00       | -         |
| 银行间买入返售证券 | 27,800,281.70       | -         |
| 合计        | 47,800,281.70       | -         |
| 项目        | 上年度末<br>2013年12月31日 |           |
|           | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所买入返售证券 | -                   | -         |
| 银行间买入返售证券 | 50,100,395.15       | -         |
| 合计        | 50,100,395.15       | -         |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未进行买断式逆回购交易。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2014年12月31日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|-----------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息  | 237.29             | 1,206.17            |
| 应收定期存款利息  | 33,055.55          | 236,833.56          |
| 应收其他存款利息  | -                  | -                   |
| 应收结算备付金利息 | 209.30             | -                   |
| 应收债券利息    | 20,668,025.23      | 1,173,449.81        |

|            |               |              |
|------------|---------------|--------------|
| 应收买入返售证券利息 | 83,135.00     | 136,850.40   |
| 应收申购款利息    | -             | 57.50        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -             | -            |
| 其他         | -             | -            |
| 合计         | 20,784,662.37 | 1,548,397.44 |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2014年12月31日 | 上年度末<br>2013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 | 67,672.30          | 9,682.06            |
| 合计          | 67,672.30          | 9,682.06            |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2014年12月31日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | -                  | -                   |
| 应付银行手续费     | 830.00             | 2,446.00            |
| 预提费用        | 96,300.00          | 349,000.00          |
| 合计          | 97,130.00          | 351,446.00          |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 泰达宏利货币 A      |                             |                   |
|---------------|-----------------------------|-------------------|
| 项目            | 本期<br>2014年1月1日至2014年12月31日 |                   |
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额              |
| 上年度末          | 156,736,411.87              | 156,736,411.87    |
| 本期申购          | 7,025,469,146.60            | 7,025,469,146.60  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -6,930,911,448.61           | -6,930,911,448.61 |
| - 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           | 251,294,109.86 | 251,294,109.86 |

金额单位：人民币元

| 泰达宏利货币 B      |  |                   |
|---------------|--|-------------------|
| 项目            | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |                   |
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额              |
| 上年度末          | -                                      | -                 |
| 本期申购          | 5,238,035,266.65                       | 5,238,035,266.65  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -4,693,904,178.25                      | -4,693,904,178.25 |
| - 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           | 544,131,088.40                         | 544,131,088.40    |

注：1. 申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

2. 本基金于 2014 年 8 月 6 日将基金份额分为 A 类和 B 类，分级前所有份额均为 A 类份额，分级当日因分级份额调整调减 A 类份额 1,026,586,870.05 份，调增 B 类份额 1,026,586,870.05 份。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 泰达宏利货币 A       |                |       |                |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 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           | 26,380,481.61  | -     | 26,380,481.61  |
| 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        | -26,380,481.61 | -     | -26,380,481.61 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

单位：人民币元

| 泰达宏利货币 B |               |       |               |
|----------|---------------|-------|---------------|
| 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     | 19,470,113.08 | -     | 19,470,113.08 |

|                |                |   |                |
|----------------|----------------|---|----------------|
| 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        | -19,470,113.08 | - | -19,470,113.08 |
| 本期末            | -              | - | -              |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
|           | 2014年1月1日至2014年12月31日 | 2013年1月1日至2013年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 78,102.62             | 33,782.80             |
| 定期存款利息收入  | 5,312,605.69          | 2,939,517.50          |
| 其他存款利息收入  | -                     | -                     |
| 结算备付金利息收入 | 16,042.86             | 1,840.42              |
| 其他        | 51,539.86             | 10,924.60             |
| 合计        | 5,458,291.03          | 2,986,065.32          |

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                              | 2014年1月1日至2014年12月31日 | 2013年1月1日至2013年12月31日 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 10,644,087.86         | 1,464,553.00          |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                     | -                     |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                     | -                     |
| 合计                           | 10,644,087.86         | 1,464,553.00          |

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                         | 2014年1月1日至2014年12月31日 | 2013年1月1日至2013年12月31日 |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额    | 5,124,653,983.06      | 1,535,196,877.48      |
| 减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额 | 5,031,565,889.20      | 1,509,725,975.00      |
| 减: 应收利息总额               | 82,444,006.00         | 24,006,349.48         |
| 买卖债券差价收入                | 10,644,087.86         | 1,464,553.00          |

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未有资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资申购差价收入。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未有衍生工具收益-其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未有股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未有公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

本基金本报告期及上年度可比期间均未有交易费用。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2014年1月1日至2014年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12<br>月31日 |
|-------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用  | 87,300.00                       | 60,000.00                            |
| 信息披露费 | 280,000.00                      | 280,000.00                           |
| 其他    | 2,652.70                        | 600.00                               |
| 账户维护费 | 36,000.00                       | 36,000.00                            |
| 银行费用  | 80,285.97                       | 49,521.54                            |
| 合计    | 486,238.67                      | 426,121.54                           |

### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益，

截止至本财务报表批准报出日，本基金共进行了三次收益集中支付。

### 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”） | 基金托管人、基金代销机构        |

|                |          |
|----------------|----------|
| 银行” )          |          |
| 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 |

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。

### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1.2 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。

##### 7.4.10.1.3 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。

##### 7.4.10.1.4 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。

##### 7.4.10.1.5 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。

#### 7.4.10.2 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                               | 上年度可比期间                          |
|-----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,385,368.01                     | 1,564,741.44                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 512,888.21                       | 368,394.79                       |

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 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                |                                  |                                  |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,025,869.10                     | 474,164.11                       |

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 X 0.1% / 当年天数。

### 7.4.10.2.3 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<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日      |            |            |
|----------------|---|------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |            |            |
|                | 泰达宏利货币 A                                    | 泰达宏利货币 B   | 合计         |
| 泰达宏利基金管理有限公司   | 569,410.02                                  | 27,188.31  | 596,598.33 |
| 中国农业银行         | 109,930.01                                  | 885.91     | 110,815.92 |
| 合计             | 679,340.03                                  | 28,074.22  | 707,414.25 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |            |            |
|                | 泰达宏利货币 A                                    | 泰达宏利货币 B   | 合计         |
| 泰达宏利基金管理有限公司   | 224,141.54                                  | -          | 224,141.54 |
| 中国农业银行         | 141,349.19                                  | 141,349.19 |            |
| 合计             | 365,490.73                                  | -          | 365,490.73 |

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。

### 7.4.10.3 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

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |               |       |      |       |      |
|----------------|--|---------------|-------|------|-------|------|
|                | 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         | 80,171,987.54                          | 81,027,726.44 | -     | -    | -     | -    |

| 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |               |               |          |          |                |           |
|---|---------------|---------------|----------|----------|----------------|-----------|
| 银行间市场<br>交易的<br>各关联方名<br>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<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金额           | 利息支出      |
| 中国农业银行                                      | 50,413,334.93 | 50,280,356.16 | -        | -        | 110,300,000.00 | 12,183.38 |

#### 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固有资金投资本基金。

##### 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

泰达宏利货币 A

份额单位：份

| 关联方名称           | 本期末<br>2014 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |                          |
|-----------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|                 | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 中国农业银行<br>涟源市支行 | 286.22                  | 0.0001%                  | 274.03                   | 0.0002%                  |

本基金的除基金管理人之外的关联方在本报告期内与上年度可比期间内均未投资泰达宏利货币市场基金 B 类基金份额。

##### 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<br>名称 | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 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    | 294,767.65                             | 78,102.62 | 241,990.30                                  | 33,782.80 |

本基金的部分银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

##### 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。

##### 7.4.10.7 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。

### 7.4.11 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

泰达宏利货币A

| 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 |
|---------------|---------------|------------|---------------|----|
| 20,512,043.44 | 5,917,947.41  | -49,509.24 | 26,380,481.61 | A类 |

泰达宏利货币B

| 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 |
|---------------|---------------|------------|---------------|----|
| 16,142,291.46 | 2,353,931.05  | 973,890.57 | 19,470,113.08 | B类 |

注：本基金在本年度累计分配收益 45,850,594.69 元，与年初应付利润 491,192.05 元，共计 46,341,786.74 元。其中 A 类份额以红利再投资方式结转入实收基金 20,512,043.44 元，包含于赎回款的已分配未支付收益 5,917,947.41 元，计入应付收益科目 441,682.81 元；B 类份额以红利再投资方式结转入实收基金 16,142,291.46 元，包含于赎回款的已分配未支付收益 2,353,931.05 元，计入应付收益科目 973,890.57 元。

### 7.4.12 期末（2014 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。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 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 135,399,596.90 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         |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 041456020 | 14 美克 CP002   | 2015 年 1 月 5 日 | 101.50 | 260,000   | 26,390,000.00  |
| 041460045 | 14 海沧投资 CP001 | 2015 年 1 月 5 日 | 100.56 | 600,000   | 60,336,000.00  |
| 041461034 | 14 万向 CP001   | 2015 年 1 月 5 日 | 100.81 | 500,000   | 50,405,000.00  |
| 合计        |               |                |        | 1,360,000 | 137,131,000.00 |

#### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 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、风险管理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控制委员会，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风险管理部负责，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。风险管理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。本基金的部分银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。定期存款存放在具有托管资格的广发银行股份有限公司和兴业银行股份有限公司，与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期

信用评级在 AAA 级以下的债券，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<br>2014 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | 653,817,048.08          | 39,980,085.89            |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | -                       | -                        |
| 合计     | 653,817,048.08          | 39,980,085.89            |

注：以上未评级的债券投资中包括国债、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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2014 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                       | -                        |
| AAA 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 99,944,133.86           | 39,685,540.45            |
| 合计     | 99,944,133.86           | 39,685,540.45            |

注：以上未评级的债券投资中包括国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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(企业债或短期融资券)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，本基金还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，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2014 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 135,399,596.90 元将在 1 个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

### 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<br>2014 年 12 月 31<br>日 | 6 个月以内         | 6 个月-1 年       | 1-5 年 | 5 年以<br>上 | 不计息           | 合计             |
|----------------------------|----------------|----------------|-------|-----------|---------------|----------------|
| 资产                         |                |                |       |           |               |                |
| 银行存款                       | 110,294,767.65 | -              | -     | -         | -             | 110,294,767.65 |
| 结算备付金                      | 465,000.00     | -              | -     | -         | -             | 465,000.00     |
| 交易性金融资<br>产                | 543,366,530.08 | 210,394,651.86 | -     | -         | -             | 753,761,181.94 |
| 买入返售金融<br>资产               | 47,800,281.70  | -              | -     | -         | -             | 47,800,281.70  |
| 应收利息                       | -              | -              | -     | -         | 20,784,662.37 | 20,784,662.37  |
| 应收申购款                      | -              | -              | -     | -         | 500.00        | 500.00         |
| 资产总计                       | 701,926,579.43 | 210,394,651.86 | -     | -         | 20,785,162.37 | 933,106,393.66 |

|                     |                |                |      |      |              |                |
|---------------------|----------------|----------------|------|------|--------------|----------------|
| 负债                  |                |                |      |      |              |                |
| 卖出回购金融资产款           | 135,399,596.90 |                |      |      |              | 135,399,596.90 |
| 应付管理人报酬             |                |                |      |      | 424,238.90   | 424,238.90     |
| 应付托管费               |                |                |      |      | 128,557.25   | 128,557.25     |
| 应付销售服务费             |                |                |      |      | 82,160.76    | 82,160.76      |
| 应付交易费用              |                |                |      |      | 67,672.30    | 67,672.30      |
| 应付利息                |                |                |      |      | 14,956.07    | 14,956.07      |
| 应交税费                |                |                |      |      | 51,309.84    | 51,309.84      |
| 应付利润                |                |                |      |      | 1,415,573.38 | 1,415,573.38   |
| 其他负债                |                |                |      |      | 97,130.00    | 97,130.00      |
| 负债总计                | 135,399,596.90 |                |      |      | 2,281,598.50 | 137,681,195.40 |
| 利率敏感度缺口             | 566,526,982.53 | 210,394,651.86 |      |      |              | 18,503,563.87  |
| 上年度末<br>2013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                | 39,241,990.30  |                |      |      |              | 39,241,990.30  |
| 交易性金融资产             | 59,736,704.70  | 19,928,921.64  |      |      |              | 79,665,626.34  |
| 买入返售金融资产            | 50,100,395.15  |                |      |      |              | 50,100,395.15  |
| 应收利息                |                |                |      |      | 1,548,397.44 | 1,548,397.44   |
| 应收申购款               | 136,292.00     |                |      |      | 772,867.87   | 909,159.87     |
| 资产总计                | 149,215,382.15 | 19,928,921.64  |      |      | 2,321,265.31 | 171,465,569.10 |
| 负债                  |                |                |      |      |              |                |
| 卖出回购金融资产款           | 13,719,873.14  |                |      |      |              | 13,719,873.14  |
| 应付管理人报酬             |                |                |      |      | 50,658.81    | 50,658.81      |
| 应付托管费               |                |                |      |      | 15,351.16    | 15,351.16      |
| 应付销售服务费             |                |                |      |      | 38,377.89    | 38,377.89      |
| 应付交易费用              |                |                |      |      | 9,682.06     | 9,682.06       |
| 应付利息                |                |                |      |      | 1,266.28     | 1,266.28       |
| 应交税费                |                |                |      |      | 51,309.84    | 51,309.84      |
| 应付利润                |                |                |      |      | 491,192.05   | 491,192.05     |
| 其他负债                |                |                |      |      | 351,446.00   | 351,446.00     |
| 负债总计                | 13,719,873.14  |                |      |      | 1,009,284.09 | 14,729,157.23  |
| 利率敏感度缺口             | 135,495,509.01 | 19,928,921.64  |      |      |              | 1,311,981.22   |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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 2014 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(2013 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) 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 2014 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工具中属于第二层次的余额为 753,761,181.94 元，无属于第一或第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日：第二层次余额为 79,665,626.34 元，无属于第一或第三层次的余额)。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次未发生重大变动。

##### (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 2014 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(2013 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) 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            | 753,761,181.94 | 80.78         |
|    | 其中：债券             | 753,761,181.94 | 80.78         |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 47,800,281.70  | 5.12          |
|    | 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      | 110,759,767.65 | 11.87         |
| 4  | 其他各项资产            | 20,785,162.37  | 2.23          |
| 5  | 合计                | 933,106,393.66 | 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 | 5.74           |                |
|    | 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 | 135,399,596.90 | 17.02          |
|    | 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

| 序号 | 发生日期             | 融资余额占基金资产净值比例 (%) | 原因   | 调整期                 |
|----|------------------|-------------------|------|---------------------|
| 1  | 2014 年 6 月 26 日  | 26.45             | 大额赎回 | 2014 年 6 月 30 日调整完毕 |
| 2  | 2014 年 6 月 27 日  | 28.27             | 大额赎回 | 2014 年 6 月 30 日调整完毕 |
| 3  | 2014 年 7 月 18 日  | 22.67             | 大额赎回 | 次日调整完毕              |
| 4  | 2014 年 8 月 27 日  | 23.34             | 大额赎回 | 2014 年 9 月 2 日调整完毕  |
| 5  | 2014 年 8 月 28 日  | 38.22             | 大额赎回 | 2014 年 9 月 2 日调整完毕  |
| 6  | 2014 年 8 月 29 日  | 27.76             | 大额赎回 | 2014 年 9 月 2 日调整完毕  |
| 7  | 2014 年 9 月 1 日   | 26.05             | 大额赎回 | 2014 年 9 月 2 日调整完毕  |
| 8  | 2014 年 9 月 10 日  | 20.49             | 大额赎回 | 次日调整完毕              |
| 9  | 2014 年 10 月 8 日  | 30.34             | 大额赎回 | 次日调整完毕              |
| 10 | 2014 年 11 月 25 日 | 22.53             | 大额赎回 | 次日调整完毕              |
| 11 | 2014 年 12 月 17 日 | 22.02             | 大额赎回 | 次日调整完毕              |

## 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    | 134 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 175 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 73  |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 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 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                 | 19.93               | 17.02               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 3.76                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 17.73               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天(含)—180 天          | 46.83               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 180 天(含)—397 天(含)      | 26.45               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 114.70              | 17.02               |

### 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                 | 99,944,133.86  | 12.56         |
|    | 其中：政策性金融债            | 99,944,133.86  | 12.56         |
| 4  | 企业债券                 | -              | -             |
| 5  | 企业短期融资券              | 653,817,048.08 | 82.20         |
| 6  | 中期票据                 | -              | -             |
| 7  | 其他                   | -              | -             |
| 8  | 合计                   | 753,761,181.94 | 94.76         |
| 9  | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -              | -             |

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  | 041456007 | 14 奇瑞 CP001   | 700,000 | 70,498,490.70 | 8.86          |
| 2  | 041460045 | 14 海沧投资 CP001 | 600,000 | 60,477,573.72 | 7.60          |
| 3  | 041460036 | 14 新疆供销 CP001 | 500,000 | 50,417,965.75 | 6.34          |
| 4  | 041477001 | 14 蓝色光标 CP001 | 500,000 | 50,385,806.82 | 6.33          |
| 5  | 041461034 | 14 万向 CP001   | 500,000 | 50,294,876.82 | 6.32          |
| 6  | 041456020 | 14 美克 CP002   | 400,000 | 40,522,665.03 | 5.09          |
| 7  | 041458036 | 14 美邦 CP001   | 400,000 | 40,341,068.31 | 5.07          |
| 8  | 140207    | 14 国开 07      | 400,000 | 40,029,169.58 | 5.03          |
| 9  | 041455015 | 14 瘦西湖 CP001  | 300,000 | 30,142,604.05 | 3.79          |
| 10 | 140213    | 14 国开 13      | 300,000 | 30,029,060.29 | 3.78          |

### 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 | 55       |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.4633%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.1642% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.1895%  |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 8.8 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

本基金本报告期内未存在剩余期限小于 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    | 20,784,662.37 |
| 4  | 应收申购款   | 500.00        |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 20,785,162.37 |

### 8.8.5 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 |
| 泰达宏利货币 A | 17,048   | 14,740.39     | 4,137,079.76   | 1.65%  | 247,157,030.10 | 98.35% |
| 泰达宏利     | 26       | 20,928,118.78 | 459,423,223.94 | 84.43% | 84,707,864.46  | 15.57% |

|      |        |           |                |        |                |        |
|------|--------|-----------|----------------|--------|----------------|--------|
| 货币 B |        |           |                |        |                |        |
| 合计   | 17,074 | 46,586.93 | 463,560,303.70 | 58.28% | 331,864,894.56 | 41.72% |

注：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）。

### 9.2 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 | 泰达宏利货币 A | 304,302.58 | 0.1211%  |
|                  | 泰达宏利货币 B | 0.00       | 0.0000%  |
|                  | 合计       | 304,302.58 | 0.0383%  |

### 9.3 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 | 泰达宏利货币 A | 0~10              |
|                                | 泰达宏利货币 B | 0                 |
|                                | 合计       | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 泰达宏利货币 A | 0                 |
|                                | 泰达宏利货币 B | 0                 |
|                                | 合计       | 0                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 | 泰达宏利货币 A         | 泰达宏利货币 B         |
|---------------------------------|------------------|------------------|
| 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                    | 156,736,411.87   | -                |
| 本报告期基金总申购份额                     | 7,025,469,146.60 | 5,238,035,266.65 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 6,930,911,448.61 | 4,693,904,178.25 |

|                          |                |                |
|--------------------------|----------------|----------------|
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额             | 251,294,109.86 | 544,131,088.40 |

注：货币 B 成立于 2014 年 8 月 6 日，详见《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利货币市场基金实施份额分类并修改基金合同、招募说明书和托管协议的公告》。

## § 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、本基金管理人于 2014 年 6 月 17 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于董事长及法定代表人变更的公告》，公司董事长及法定代表人变更为弓劲梅女士。

2、2014 年 6 月 20 日，经本基金管理人股东会批准，本基金管理人独立董事由孔晓艳女士变更为杜英华女士。本变更事项已按规定向监管部门报备。

3、本基金托管人中国农业银行股份有限公司任命余晓晨先生主持托管人托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

### 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(特殊普通合伙)审计费用为 8.73 万元，该审计机构对本基金已提供审计服务的年限为 9 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

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监管部门稽查或处罚的情况。

## 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      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 渤海证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

(一) 2014 年本基金无交易单元增减情况。

(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 |
| 中银国际 | -    | -            | 2,892,500,000.00 | 97.14%         | -    | -            |
| 渤海证券 | -    | -            | 85,138,000.00    | 2.86%          | -    | -            |

## 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。

## 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  | 《泰达宏利基金管理有限公司关于暂停泰达宏利货币市场基金 T+0 快速赎回业务的公告》 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 | 2014 年 1 月 27 日 |

|   |   |                             |                |
|---|---|-----------------------------|----------------|
| 2 | 《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利货币市场基金实施份额分类并修改基金合同、招募说明书和托管协议的公告》 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 | 2014 年 8 月 4 日 |
| 3 | 《泰达宏利基金管理有限公司关于网上直销平台调整货币基金 A 类申购金额下限的公告》             | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 | 2014 年 9 月 4 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 6、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  
2015 年 3 月 27 日