

## 泰达宏利活期友货币市场基金招募说明书（更新）摘要

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

### 【重要提示】

本基金于 2015 年 1 月 4 日经中国证监会证监许可号[2015]9 号文注册，并于 2015 年 9 月 9 日获得中国证监会证券投资基金机构监管部关于泰达宏利活期友货币市场基金延期募集备案的回函（机构部函[2015]2516 号）。本基金的基金合同于 2015 年 11 月 4 日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金收益会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金为货币市场基金，风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，投资者在进行投资决策前，

请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2016 年 11 月 4 日，有关数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日。财务数据未经审计。

## 第 1 部分 基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：泰达宏利基金管理有限公司

成立日期：2002 年 6 月 6 日

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

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

法定代表人：弓劲梅

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-66577808

信息披露联系人：陈沛

注册资本：一亿八千万元人民币

股权结构：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%

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、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、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、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利收益增强债券型证券投资基金、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、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定期开放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、泰达宏利多元回报债券型证券投资基金、泰达宏利增利灵活配置定期开放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在内的四十多只证券投资基金。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

弓劲梅女士，董事长。拥有天津南开大学经济学博士学位。曾担任天津信托有限责任公司研究员，天弘基金管理有限公司高级研究员，天津泰达投资控股有限公司高级项目经理，天津市泰达国际控股（集团）有限公司融资与风险管理部副部长。现任天津市泰达国际控股（集团）有限公司资产管理部部长。

刘建先生，董事。先后毕业于中国政法大学、天津财经学院，获法学学士、经济学硕士学位。1988年至2001年任中国建设银行股份有限公司金融机构部副处长；2001年至2003年任中信银行股份有限公司资金清算中心负责人；2003年至2014年任中银国际证券有限责任公司机构业务部董事总经理。2014年10月加盟泰达宏利基金管理有限公司，2015年4月任公司副总经理，2015年8月起任公司总经理。

杨雪屏女士，董事。拥有天津大学工科学士和中国人民大学新闻学硕士学位。1995年至2003年曾在天津青年报社、经济观察报社、滨海时报社等报社担任记者及编辑；2003年至2012年就职于天津泰达投资控股有限公司办公室秘书科；自2012年至今就职于天津市泰达国际控股（集团）有限公司，曾担任资产管理部高级项目经理，现任综合办公室副主任。

孙泉先生，董事。拥有天津南开大学经济学学士和经济学硕士学位及美国芝加哥罗斯福大学工商管理硕士学位。1988年任职于天津开发区信托投资公司，负责信贷和外汇管理工作；1989年任职于天津开发区管理委员会政策研究室，负责区域发展、国企改革、对外合作政策的研究和制定工作；1997年任职于天津经济技术开发区总公司企划部，负责企业发展战略研究和计划经营管理工作；2001年任职于天津泰达投资控股公司资产管理部，负责泰达控股重组并购、资源整合、上市筹备和金融类、实业类企业的经营管理工作。现任天津泰达投资控股公司资产

管理部经理，渤海产业基金投资管理公司、恒安标准人寿保险公司和天津钢管集团股份有限公司董事等职。

何达德先生，董事。毕业于英国伦敦城市大学，取得精算学荣誉理学士学位。现为宏利行政副总裁及宏利人寿保险（国际）有限公司首席行政总监，宏利资产管理（香港）有限公司首席行政总监，负责宏利于香港的全线业务，包括个人保险、雇员福利及财富管理等业务。同时何先生分别为宏利人寿保险（国际）有限公司及宏利资产管理（香港）有限公司之董事。现为澳大利亚精算学会及美国精算学会会员，在寿险及退休顾问工作方面拥有三十多年的丰富经验，其间担任多个领导层要职。

任赛华女士，董事。毕业于加拿大滑铁卢大学（University of Waterloo），获得数学学士学位，加拿大安大略省会计师公会之特许会计师。任女士于 2007 年加盟宏利资产，曾任首席行政事务总监，现担任宏利资产亚洲区零售经销部主管。早年任女士曾任职于亚洲和加拿大的著名国际投资银行、会计事务所及省级退休金委员会，监管托管业务的销售及担任全球基金服务客户关系管理、新业务发展及会计等高级职务。2013 年 6 月至 2015 年 4 月担任泰达宏利基金管理有限公司监事。

杜汶高先生，董事。毕业于美国卡内基梅隆大学，持有数学及管理科学理学士学位，现为宏利资产管理(亚洲)总裁兼亚洲区主管及宏利资产管理(香港)有限公司董事，掌管亚洲及日本的投资事务，专责管理宏利于区内不断壮大的资产，并确保公司的投资业务符合监管规定。出任现职前，杜先生掌管宏利于亚洲区(香港除外)的投资事务。2001 年至 2004 年，负责波士顿领导机构息差产品的开发工作。杜先生于 2001 年加入宏利，之前任职于一家环球评级机构，曾获派驻纽约、伦敦及悉尼担任杠杆融资及资产担保证券等不同部门的主管，拥有二十多年的资本市场经验。

汪丁丁先生，独立董事，毕业于北京师范学院数学系，中国科学院数学力学部理学硕士学位，1990 年获夏威夷大学经济学博士学位。1984 年至 1998 年先后担任中国科学院系统科学研究所助理研究员、美国东西方中心人口研究所访问学者、博士后研究员、香港大学经济与金融学院助理教授、德国杜伊斯堡大学经济系客座教授、北京大学中国经济研究中心副教授及美国夏威夷大学经济系访问教授。目前担任北京大学及浙江大学教授，自 2007 年至今，担任东北财经大学“社会与行为”跨学科教育中心学术委员会主席兼主任。

周小明先生，独立董事。毕业于浙江大学法学院，持有中国政法大学法学硕士学位、民商法法学博士学位。1990 年起先后任职于浙江大学、中国人民银行非银行

金融机构监管司、君泽君律师事务所、安信信托投资股份有限公司。曾担任全国人大常委会财经委员会《中华人民共和国信托法》、《基金法》起草小组成员、安信信托投资股份有限公司总裁。目前担任中国人民大学信托与基金研究所所长、君泽君律师事务所合伙人、清华大学法学院联合法律硕士导师、中国信托业协会培训与资格办公室副主任、《中国信托业发展报告》主编。

杜英华女士，独立董事，任期始于 2014 年 6 月 20 日。毕业于南开大学法律系，获得法学学士和法学硕士学位。1992 年 10 月，与其他合伙人共同发起设立天津津华律师事务所，现任该律所副主任，正高级律师，具有 22 年法律实务经验。

同时担任天津第五届律师协会理事、天津第六届律师协会监事。

何自力先生，独立董事，1982 年毕业于南开大学，经济学博士。1975 年至 1978 年，于宁夏国营农场和工厂务农和做工；1982 年至 1985 年，于宁夏自治区党务从事教学和科研工作；1988 年至今任职于南开大学，历任经济学系系主任、经济学院副院长，担任教授、博士生导师；兼任中国经济发展研究会副会长和秘书长、天津经济学会副会长；2002 年 1 月至 7 月在美国加利福尼亚大学伯克利分校作访问学者。

## 2、监事会成员

许宁先生，监事长。毕业于南开大学，经济学硕士。1991 年至 2008 年任职于天津市劳动和社会保障局；2008 年加入天津市泰达国际控股（集团）有限公司，担任党委委员、董事会秘书、综合办公室主任。

陈景涛先生，监事。拥有澳大利亚麦考瑞大学商学学士、麦考瑞大学应用金融学硕士和南澳大学金融学博士学位。1998 年起先后就职于渣打银行、巴克莱资本、Baron Asset Management；2005 年加入宏利资产，曾担任固定收益高级投资经理，现担任北亚投资负责人。

王泉先生，职工监事。管理学学士、经济学硕士。2002 年 3 月加入泰达宏利基金管理有限公司工作至今，历任基金运营部基金会计、基金运营部副总经理、基金运营部总经理、运营副总监兼基金运营部总经理，自 2014 年 10 月起担任运营总监。

邓艺颖女士，职工监事。金融学硕士，2004 年 5 月至 2005 年 4 月就职于中国工商银行广东省分行公司业务部；2005 年 4 月加盟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、研究部副总监、投资副总监兼研究部总监，现任投资副总监兼投资部总监。具备 11 年基金从业经验，11 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

## 3、高级管理人员

弓劲梅女士，董事长。简历同上。

刘建先生，总经理。简历同上。

傅国庆先生，副总经理。毕业于南开大学和美国罗斯福大学，获文学学士和工商管理硕士学位，北京大学国家发展研究院 EMBA。1993 年至 2006 年就职于北方国际信托股份有限公司，从事信托业务管理工作，期间曾任办公室主任、研发部经理、信托业务总部总经理、董事会秘书、以及公司副总经理。2006 年 9 月起任泰达宏利基金管理有限公司财务总监；2007 年 1 月起任公司副总经理兼财务总监。

王彦杰先生，副总经理。毕业于台湾中山大学和淡江大学，获企业管理学士和财务金融硕士学位。1998 年 8 月至 2001 年 4 月，先后在国际证券、日商大和证券、元大投信担任股票分析师；2001 年 5 月至 2008 年 2 月，任保德信投信股票投资主管；2008 年 2 月至 2008 年 8 月，就职于复华投信香港资产管理公司，担任执行长；2008 年 8 月至 2015 年 10 月，就职于宏利资产管理有限公司，担任台湾地区投资主管；2015 年 10 月加盟泰达宏利基金管理有限公司担任投资总监，2015 年 12 月起任泰达宏利基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

张萍女士，督察长。毕业于中国人民大学和中国科学院，管理学和理学双硕士。先后任职于中信公司、毕马威国际会计师事务所等公司，从事财务管理和管理咨询工作。2002 年起在嘉实基金管理有限公司工作，任监察稽核部副总监。2005 年 10 月起任泰达宏利基金管理有限公司风险管理部总监。2006 年 11 月起任泰达宏利基金管理有限公司督察长。

#### 4、基金经理

丁宇佳女士，理学学士；2008 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任交易部交易员，负责债券交易工作；2013 年 9 月起先后担任固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理；2015 年 3 月 26 日起担任泰达宏利货币市场基金基金经理；

2015 年 6 月 11 日至今担任泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）基金经理；

2015 年 6 月 11 日至今担任泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理；

2015 年 6 月 16 日至今担任泰达宏利养老收益混合型证券投资基金基金经理；

2015 年 6 月 16 日至今担任泰达宏利淘利债券型证券投资基金基金经理；2015 年

6 月 16 日起至今担任泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理；

2015 年 6 月 18 日起至今担任泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；

2015 年 11 月 4 日起担任泰达宏利活期友货币市场基金基金经理；2016 年

9 月 26 日至今担任泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金基金经理；

2016 年 9 月 26 日至今担任泰达宏利风险预算混合型证券投资基金基金经理；

2016 年 9 月 26 日至今担任泰达宏利集利债券型证券投资基金基金经理；2016 年

9月29日至今担任泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金基金经理；具备8年基金从业经验，8年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

#### 5、投资决策委员会成员名单

投资决策委员会成员包括公司总经理刘建、副总经理兼投资总监王彦杰、投资副总监兼基金投资部总监邓艺颖、研究部总监陈伯祯、金融工程部门负责人戴洁、资深基金经理兼首席策略分析师庄腾飞。督察长张萍列席会议。

投资决策委员会根据决策事项，可分类固定收益类事项、权益类事项、其它事项：

(1) 固定收益类事项由刘建、王彦杰表决。

(2) 权益类事项由刘建、王彦杰、邓艺颖、戴洁、庄腾飞、陈伯祯表决。

(3) 其它事项由全体成员参与表决。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 第2部分 基金托管人

### (一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### (二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增

值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2016 年 09 月 30 日，中国银行已托管 502 只证券投资基金，其中境内基金 471 只，QDII 基金 31 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2016 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 第 3 部分 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### 1) 泰达宏利基金管理有限公司直销中心

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

联系人：于贺



联系电话：010-66577617

客服信箱：irm@mfcteda.com

客服电话：400-698-8888

传真：010-6657760/61

公司网站：<http://www.mfcteda.com>

## 2) 泰达宏利基金网上直销系统

交易系统网址：<https://etrade.mfcteda.com/etrading/>

支持基金管理人旗下基金网上直销的银行卡和第三方支付有：农行卡、建行卡、民生银行卡、招商银行卡、兴业银行卡、中信银行卡、光大银行卡、交通银行卡、浦发银行卡、中国银行卡、广发银行卡、上海银行卡和汇付天下“天天盈”、快钱支付账户。

泰达宏利微信公众账号：mfcteda\_BJ，支持民生银行卡、招商银行卡、汇付天下“天天盈”账户、快钱支付账户。

客户服务电话：400-698-8888 或 010-66555662

客户服务信箱：irm@mfcteda.com

## 2、销售机构

### 1) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

银行网站：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

### 2) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

银行网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

### 3) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：（021）61618888

传真：（021）63604199

联系人：虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

4) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

办公地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

电话：021-38637673

传真：021-50979507

联系人：张莉

客户服务热线：95511-3

公司网站：bank.pingan.com

5) 东莞银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区体育路 21 号

办公地址：广东省东莞市莞城区体育路 21 号

法定代表人：卢国锋

电话：0769-22119061

传真：0769-22117730

联系人：陈幸

客服电话：4001196228

公司网址：www.dongguanbank.cn

6) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-89068340

传真：0574-87050024

联系人：胡技勋

客户服务热线：95574

公司网站：www.nbcb.com.cn

7) 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河东区海河东路 218 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号法定代表人：李伏安

电话：022-58316666

传真：022-58316259

联系人：王宏

客户服务热线：95541

公司网站：www.cbhb.com.cn

8) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客服电话：95521

联系人：芮敏祺

公司网站：www.gtja.com

9) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客服电话：400-888-8108

传真：010-65182261

公司网站：www.csc108.com

10) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

联系人：周杨

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

公司网站：www.guosen.com.cn

11) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

联系电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565，400-888-8111

公司网址：www.newone.com.cn

12) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客服电话：4008-888-888

电话：010-66568450

联系人：宋明

公司网站：www.chinastock.com.cn

13) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客服电话：95553，400-8888-001

联系电话：021-23219000

公司网站：www.htsec.com

14) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系电话：021-33389888

客服电话：95523 或 400-889-5523

网址：www.swhysc.com

15) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20 层

法定代表人：兰荣

联系人：黄英

联系电话：0591-38162212

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

16) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 层

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 层

法定代表人：林俊波

客服电话：400-888-1551

传真：021-68865680

公司网站：www.xcsc.com

17) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：胡天彤

电话：022-28451709

传真：022-28451892

电子邮箱：hutt@bhq.com

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.bhq.com

18) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场法定代表人：周易

客户服务电话：95597

传真：0755-82492962

联系人：庞晓芸

公司网站：www.htsc.com.cn

19) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000 400-6666-888

公司网址: [www.cgws.com](http://www.cgws.com)

20) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

联系人: 刘晨、李芳芳

客户服务电话: 95525 400-888-8788 101-089-98

传真: 021-22169134

公司网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

21) 广州证券股份有限公司

注册地址: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼

办公地址: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼

法定代表人: 邱三发

客服电话: 020-961303

联系电话: 020-88836999

传真: 020-88836654

联系人: 林洁茹

网址: [www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

22) 东北证券股份有限公司

注册地址: 长春市自由大路 1138 号

办公地址: 长春市自由大路 1138 号

法定代表人: 矫正中

联系人: 安岩岩

电话: 0431-85096517

客户服务电话: 400-600-0686

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

23) 新时代证券股份有限公司

注册地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人: 刘汝军

联系人: 孙恺

客户服务电话: 400-698-9898

公司网址: [www.xsdzq.cn](http://www.xsdzq.cn)

24) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：吴琼

全国免费业务咨询电话：95511

传真：0755-82400862

网址：[www.PINGAN.com](http://www.PINGAN.com)

25) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层（100007）

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层（100007）

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

26) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

公司网络地址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

客服电话：95531，400-888-8588

27) 金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人：陆涛

客户服务电话：400-888-8228

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网站：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

28) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

客服电话：400-888-8128

传真：021-68767981

联系人：朱磊

公司网站：www.tebon.com.cn

29) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：96326（福建省外请先拨 0591）

传真：0591-87383610

联系人：张宗锐

公司网站：www.hfzq.com.cn

30) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

客服电话：400-800-1001

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82825551

网址：www.essence.com.cn

31) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼（410005）

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼（410005）

法定代表人：蔡一兵

联系人：郭磊

联系电话：0731-84403319

开放式基金业务传真：0731-84403439

网址：www.cfzq.com

32) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮



客服电话：95538

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

33) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦  
20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼

法定代表人：许建平

电话：010-88085858

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

34) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579 或 400-888-8999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

35) 国金证券股份有限公司

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

客服电话：95310

公司网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

36) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

公司网址：[www.citics.com](http://www.citics.com)

客服热线：95548

37) 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

办公地址：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

公司网址：www.westsecu.com

客服热线：95582

38) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层，深圳市华侨城深南大道 9010 号

法定代表人：吴永良

公司网址：www.zszq.com

客服热线：400-102-2011

39) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：周俊

电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

公司网址：www.jhzq.com.cn

客服热线：400-666-2288

40) 万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人：张建军

公司网址：www.wlzq.com.cn

客服热线：400-888-8133

41) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 20 层

办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

公司网址：www.citicssd.com

客服热线：95548

42) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦 5 楼

法定代表人：吴坚

公司网址：www.swsc.com.cn

客服热线：400-809-6096

43) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

公司网址：www.citicsf.com

客服电话：400-990-8826

44) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 8 楼

法定代表人：汪静波

公司网址：www.noah-fund.com

客服热线：400-821-5399

45) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 1 号物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

公司网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

客服热线：4006-788-887

46) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

公司网址：www.ehowbuy.com

客服热线：400-700-9665

47) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：杭州市西湖区天目山路 266 号黄龙时代广场 B 座支付宝

法定代表人：陈柏青

客服电话：400-076-6123

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

48) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C-9 楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

49) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：刘潇

电话：021-021-20691942 传真：021-20691861

客服电话：400-820-2899

公司网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

50) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：刘英

联系电话：021-20835817

传真号码：021-20835885

全国统一客服热线：400-920-0022/ 021-20835588

公司网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

51) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦二层

法定代表人：闫振杰

全国统一客服热线：400-888-6661

公司网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

52) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

客户服务热线：4008-773-772

公司网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

53) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室

地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

客户服务热线：400-001-1566

公司网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

54) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

客户服务热线：400-820-2819

公司网址：<https://tty.chinapnr.com>

55) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

客户服务热线：400-821-9031

公司网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

56) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

客户服务热线：400-928-2266

公司网址：<http://www.dtfortune.com>

57) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：浙江省杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

地址：浙江省杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

法定代表人：徐黎云

客户服务热线：400-068-0058

公司网址：[http:// www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

58) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 17 层

法定代表人：杨懿

客户服务热线：400-166-1188

公司网址：<http://money.jrj.com.cn>

59) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

客户服务热线：400-046-6788

公司网址：<http://www.66money.com>

60) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

客服热线：4000-618-518

网址：[www.ncfjj.com](http://www.ncfjj.com)

61) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七

幢 23 层 1 号 4 号

办公地址：武汉市泛海国际 SOHO 城 7 栋 2301、2304

法定代表人：陶捷

公司网址：<http://www.buyfunds.cn>

客服热线：400-027-9899

62) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层 2302#

法定代表人：李悦

客户服务热线：4008-980-618

公司网址：www.chtfund.com

63) 北京广源达信投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区宏泰东街浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

公司网址：<http://www.niuguwang.com>

客服热线：400-623-6060

64) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 21-28 层

公司网址：[www.gscaifu.com](http://www.gscaifu.com)

客服热线：400-818-8866

65) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪  
总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

客服电话：010-62675369

公司网址：<http://www.xincai.com/>

66) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

公司网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

67) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经  
济发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

电话：021-65370077-209

公司网站：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

68) 北京汇成基金管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-90595

网址：www.fundzone.cn

69) 上海云湾投资管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

法定代表人：戴新装

企业类型：有限责任公司

营业期限：持续经营

客服电话：400-820-1515

网址：www.zhengtongfunds.com

70) 上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

注册资本：人民币 2000 万元

企业类型：有限责任公司

电话：021-5132 7185

传真：021-5071 0161

71) 天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室

办公地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室

法定代表人：丁东华

公司网址：www.gomefund.com

客服热线：400-111-0889

72) 北京格上富信投资顾问有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

联系人：曹庆展

客户服务电话：400-066-8586



公司网址: [www.igesafe.com](http://www.igesafe.com)

(二) 登记机构

名称: 泰达宏利基金管理有限公司

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

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

法定代表人: 弓劲梅

联系人: 石楠

联系电话: 010-66577769

传真: 010-66577750

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称: 北京天达共和律师事务所

注册地址: 北京市朝阳区麦子店街37号盛福大厦1930室

办公地址: 北京市朝阳区麦子店街37号盛福大厦1930室

负责人: 李东明

电话: 010-85276468

传真: 010-85275038

经办律师: 韩津生、张璇

联系人: 张璇

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称: 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址: 上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

法定代表人: 赵柏基

经办注册会计师: 单峰、庞伊君

联系电话: (021) 23238888

传真: (021) 23238800

联系人: 庞伊君

第4部分 基金的名称

泰达宏利活期友货币市场基金

## 第 5 部分 基金的类型

契约型开放式。

## 第 6 部分 基金的投资目标

在有效控制风险，保持流动性的前提下，力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。

## 第 7 部分 基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券、一年以内(含一年)的银行存款和大额存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券和中期票据、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据和债券回购、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持类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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 第 8 部分 基金的投资策略

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。

### 1、利率预期策略

本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标、分析宏观经济情况，建立经济前景的情景模拟，在宏观分析与流动性分析的基础上，结合历史与经验数据，确定当前资金的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价等要素，得到当前宏观与流动性条件下的均衡收益率曲线。区分当前利率债收益率曲线期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位，然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线参数变动的程度和概率，确定组合的平均剩余期限，并据此动态调整投资组合。

### 2、期限配置策略

在短期利率期限结构分析的基础上，根据对投资对象流动性和收益性的动态考察，构建合理期限结构的投资组合。从组合总的剩余期限结构来看，一般说来，预期利率上涨时，将适当缩短组合的平均期限；预期利率下降时，将在法律法规允许

的范围内适当延长组合的平均剩余期限。

### 3、券种配置策略

本基金将根据经济发展水平及货币政策的变动，首先对信用债、利率债等券种的到期收益率与风险进行综合比较，确定优先配置的资产类别，并结合各类投资工具的市场容量，确定配置比例。

### 4、银行定期存款及大额存单投资策略

银行定期存款及大额存单是本基金的主要投资对象，因此，银行定期存款及大额存单的投资将是本基金关注的重点之一。具体而言，在组合投资过程中，本基金将在综合考虑成本收益的基础上，尽可能的扩大交易对手方的覆盖范围，通过对这些银行广泛、耐心而细致的询价，挖掘出利率报价较高的多家银行进行银行定期存款及大额存单的投资，在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险，提高存款及存单资产的流动性。

### 5、资产支持证券投资策略

当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主（包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产），仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

### 6、流动性管理策略

本基金将会紧密关注申购/赎回现金流变化情况、季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素，建立组合流动性监控管理指标，实现对基金资产流动性的实时管理。

具体而言，本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、银行定期存款提前支取、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性，也可采用持续滚动投资方法，将回购或债券的到期日进行均衡等量配置，以满足日常的基金资产变现需求。

## 第9部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款税后利率。

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。

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

#### 第 10 部分 基金的风险收益特征

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。

#### 第 11 部分 基金的投资组合报告

##### 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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 11 月 23 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。

本投资组合报告所载数据截止 2016 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 2、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 761,353,385.15 52.66

其中：债券 761,353,385.15 52.66

资产支持证券 -

-

2 买入返售金融资产 510,501,685.75

35.31

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 170,344,137.99 11.78

4 其他资产 3,548,564.55 0.25

5 合计 1,445,747,773.44 100.00

##### 3、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 11.80

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	163,999,554.00	12.80
其中：买断式回购融资 --			

注：上表中，报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，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日融资余额占基金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	2016 年 7 月 1 日	20.89	大额赎回	2016 年 7 月 6 日调整完毕
2	2016 年 7 月 4 日	21.03	大额赎回	2016 年 7 月 6 日调整完毕
3	2016 年 7 月 5 日	22.68	大额赎回	2016 年 7 月 6 日调整完毕

注：调整期从正回购资金余额超过基金资产净值比例 20%后的第一个交易日计算。

#### 4、基金投资组合平均剩余期限

##### 4.1 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 105

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 118

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 52

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。

##### 4.2 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	46.90	12.80
其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --			
2	30 天(含)-60 天	3.13	-
其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 2.35 -			
3	60 天(含)-90 天	12.44	-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --  
 4 90 天(含)-120 天 14.45 --  
 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --  
 5 120 天(含)-397 天(含) 35.66 --  
 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --  
 合计 112.58 12.80

#### 5、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。

#### 6、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	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	95,384,071.29	7.45
	其中：政策性金融债	95,384,071.29	7.45
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	289,820,760.43	22.62
6	中期票据	--	--
7	同业存单	376,148,553.43	29.36
8	其他	--	--
9	合计	761,353,385.15	59.43
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	30,078,170.82	2.35

#### 7、报告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

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	111697893	16 南京银行 CD112	1,000,000	98,571,738.32	7.69
2	011699583	16 国电 SCP003	500,000	50,098,188.81	3.91
3	011698353	16 首钢 SCP003	500,000	49,976,325.49	3.90
4	111692292	16 包商银行 CD016	500,000	49,957,454.78	3.90
5	011698511	16 澜沧江 SCP006	500,000	49,955,455.89	3.90

6	111694892	16	徽商银行 CD068	500,000	49,950,798.39	3.90
7	011611009	16	大唐集 SCP009	500,000	49,941,470.19	3.90
8	011698276	16	陕延油 SCP004	500,000	49,860,619.46	3.89
9	111697984	16	宁夏银行 CD044	500,000	49,647,225.16	3.88
10	150417	15	农发 17	300,000	30,269,755.03	2.36

## 8、“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 -

报告期内偏离度的最高值 0.1826%

报告期内偏离度的最低值 0.0547%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.1223%

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。

## 9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 10、投资组合报告附注

### 10.1

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。

### 10.2

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 10.3 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	-
3 应收利息	3,477,563.55
4 应收申购款	71,001.00
5 其他应收款	-
6 待摊费用	-
7 其他	-
8 合计	3,548,564.55

#### 10.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

10.4.1 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。

10.4.2 报告期内，本基金买入中铝国际工程股份有限公司 2016 年度第二期超短期融资券“16 中铝国工 SCP002”。报告期末已不持有该券。

#### 第 12 部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为 2015 年 11 月 4 日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

##### （一）历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

泰达宏利活期友货币 A

阶段 基金净值收益率

① 基金净值收益率标准差② 比较基准收益率

③ 比较基准收益率标准差

④ ①-③ ②-④

2015 年 11 月 4 日-12 月 31 日 0.3774% 0.0050% 0.2145% 0.0000% 0.1629%

0.0050%

2016 年 1 月 1 日-9 月 30 日 1.9401% 0.0040% 1.0134% 0.0000% 0.9267%

0.0040%

基金合同生效日至 2016 年 9 月 30 日 2.3248% 0.0042% 1.2279% 0.0000%

1.0969% 0.0042%



泰达宏利活期友货币 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

2015 年 11 月 4 日-12 月 31 日 0.4153% 0.0050% 0.2145% 0.0000% 0.2008%  
0.0050%

2016 年 1 月 1 日-9 月 30 日 2.1241% 0.0040% 1.0134% 0.0000% 1.1107%  
0.0040%

基金合同生效日至 2016 年 9 月 30 日 2.5482% 0.0042% 1.2279% 0.0000%  
1.3203% 0.0042%

注：1、本基金的业绩比较基准：同期七天通知存款利率(税后)。

2、本基金收益分配按日结转份额。

(二) 泰达宏利活期友货币市场基金自基金合同生效以来基金累计净值收益率与  
业绩比较基准收益率历史走势对比图

本基金成立于 2015 年 11 月 4 日，截止报告期末本基金成立不满一年。按基金合  
同规定，自基金合同生效日起六个月内为建仓期。本基金在建仓期结束时及截止  
报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

### 第 13 部分 基金费用与税收

#### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；

9、证券账户开户费用、银行账户维护费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30 %年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3. 基金销售服务费

本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中

一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第4—9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒介上公告。

### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 第14部分 对招募说明书更新部分的说明

（一）在“重要提示”中，更新了招募说明书所载内容、有关财务数据和净值表现的截止日期。

（二）“三、基金管理人”部分对基金管理人概况、监事会成员、基金经理、投资决策委员会等进行了更新及增加内容。

（三）对“四、基金托管人”部分进行了更新。

（四）“五、相关服务机构”部分对代销机构信息进行了更新。

（五）“九、基金的投资”部分对投资组合报告内容更新至2016年9月30日。

（六）“十、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2016年9月30日，并更新了历史走势对比图。

（七）“二十二、其他应披露事项”部分对报告期内应披露的本基金相关事项进行了更新。

泰达宏利基金管理有限公司

2016年12月19日