

# 泰达宏利活期友货币市场基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2021 年 8 月 27 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现</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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 债券回购融资情况.....	35
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	35
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	37

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	37
7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 .....	37
7.9 投资组合报告附注.....	38
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	40
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>40</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	41
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	42
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>42</b>
11.1 备查文件目录.....	42
11.2 存放地点.....	42
11.3 查阅方式.....	42

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利活期友货币市场基金	
基金简称	泰达宏利活期友货币	
基金主代码	001894	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 11 月 4 日	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,064,462,910.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利活期友货币 A	泰达宏利活期友货币 B
下属分级基金的交易代码	001894	001895
报告期末下属分级基金的份额总额	1,064,462,910.77 份	-份

### 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的长期风险和收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐娇娇	许俊
	联系电话	66577766	010-66594319
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-698-8888	95566
传真		010-66577666	010-66594942
注册地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100026	100818

法定代表人	刘轶	刘连舸
-------	----	-----

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.mfcteda.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰达宏利基金管理有限公司	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	泰达宏利活期友货币 A	泰达宏利活期友货币 B
本期已实现收益	9,595,360.97	-
本期利润	9,595,360.97	-
本期净值收益率	1.1736%	1.1736%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	期末基金资产净值	1,064,462,910.77
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	累计净值收益率	17.1132%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

2. 所述基金业绩指标不包括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. 本基金收益分配按日结转份额。

4. 截止至 2021 年 6 月 30 日本基金 B 级份额为零。

### 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

泰达宏利活期友货币 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
过去一个月	0.1897%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.0787%	0.0004%
过去三个月	0.5651%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.2285%	0.0004%
过去六个月	1.1736%	0.0009%	0.6695%	0.0000%	0.5041%	0.0009%
过去一年	2.1913%	0.0014%	1.3500%	0.0000%	0.8413%	0.0014%
过去三年	7.5077%	0.0030%	4.0537%	0.0000%	3.4540%	0.0030%
自基金合同生效起至今	17.1132%	0.0061%	7.6414%	0.0000%	9.4718%	0.0061%

泰达宏利活期友货币 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
过去一个月	0.1897%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.0787%	0.0004%
过去三个月	0.5651%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.2285%	0.0004%
过去六个月	1.1736%	0.0009%	0.6695%	0.0000%	0.5041%	0.0009%

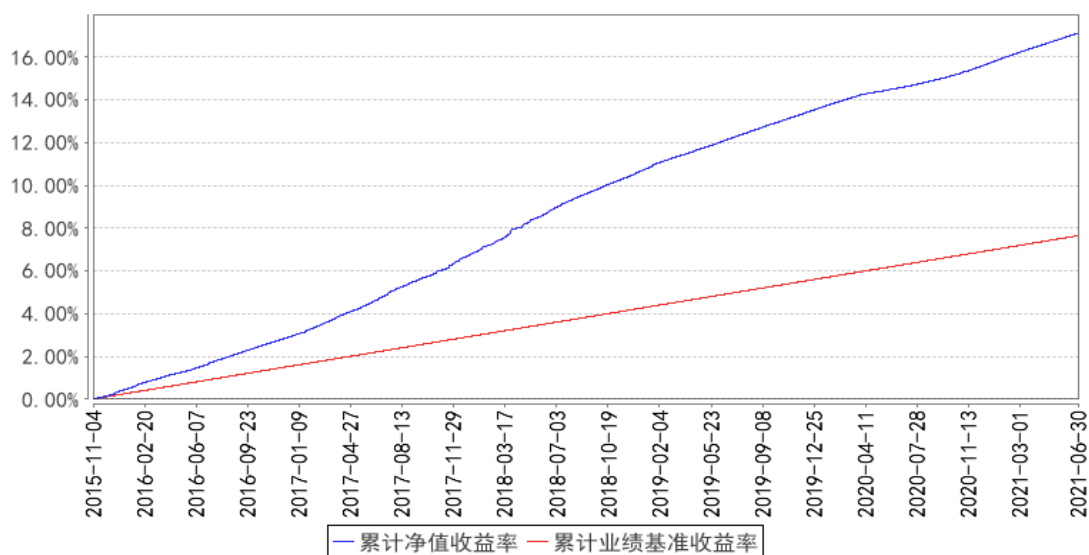
过去一年	2.2235%	0.0013%	1.3500%	0.0000%	0.8735%	0.0013%
过去三年	8.0597%	0.0030%	4.0537%	0.0000%	4.0060%	0.0030%
自基金合同生效起至今	18.4658%	0.0062%	7.6414%	0.0000%	10.8244%	0.0062%

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。

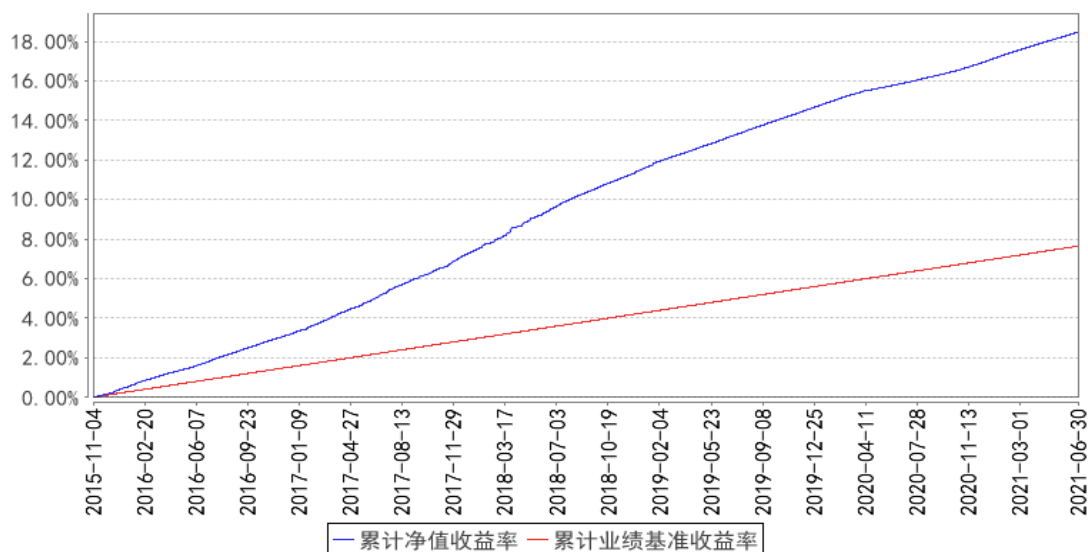
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泰达宏利活期友货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





泰达宏利活期友货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于2002年6月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：天津市泰达国际控股（集团）有限公司：51%；宏利投资管理（香港）有限公司：49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利宏达混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利

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、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利印度机会股票型证券投资基金(QDII)、泰达宏利鑫利半年定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利永利债券型证券投资基金、泰达宏利品牌升级混合型证券投资基金、泰达宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金、泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利价值长青混合型证券投资基金、泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金、泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、泰达宏利消费服务混合型证券投资基金、泰达宏利新能源股票型证券投资基金、泰达宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜磊	基金经理	2020 年 1 月 19 日	-	10 年	美国伊利诺伊大学芝加哥分校工商管理硕士，2009 年 7 月至 2010 年 7 月任职于大公国际资信评估有限公司，担任信用评级分析；2011 年 11 月至 2013 年 8 月任职于光大证券股份有限公司，担任金融市场部高级经理；2013 年 8 月至 2015 年 12 月任职于中信建投证券股份有限公司，担任固定收益部副总裁；2016 年 5 月至 2019 年 9 月任职于先锋基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益副总监兼基金经理；2019 年 10 月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于固定收益部，先后担任

					产品经理、基金经理助理，现任基金经理；具备 5 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
李祥源	基金经理助理	2020 年 10 月 23 日	-	6 年	澳洲国立大学金融管理硕士，2012 年 9 月至 2013 年 3 月任职于普华永道咨询(深圳)有限公司北京分公司，担任税务部助理分析师；2013 年 4 月至 2015 年 5 月任职于联合资信评估有限公司，担任工商企业部分分析师；2015 年加入泰达宏利基金管理有限公司，曾任助理研究员、研究员、基金经理助理，现任基金经理，具备 6 年基金从业经验，具有基金从业资格。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，债市维持震荡格局，收益率整体呈下行趋势。上半年经济继续修复，地产基建边际转弱，进出口数据仍维持较强韧性，消费数据持续改善。PPI 数据继续走高，半年末环比回落，尚未向 CPI 充分传导，猪肉价格处于底部，整体通胀压力不大。央行货币政策仍以稳字当头，更加注重结构性工具精准质效。资金面保持宽松平稳状态，总体表现略超预期，价格中枢始终维持在 2.2% 附近。上半年财政政策偏紧，地方政府债务监管趋严，优化资金配置支出节奏放缓，财政后置或成定局。

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期泰达宏利活期友货币 A 的基金份额净值收益率为 1.1736%，本报告期泰达宏利活期友货币 B 的基金份额净值收益率为 1.1736%，同期业绩基准收益率为 0.6695%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，货币政策尚未进入对冲状态，是否进一步宽松还需关注基本面的变化，债市目前仍缺少明确趋势性方向。地方债和专项债发行节奏或将提速，欠配压力得以逐步缓解，或伴随着资金面波动率的边际而提升。短期看受流动性充裕与信贷缺口收窄的影响，同业存单利率仍有下行动力，但下行幅度较为有限。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同

业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在泰达宏利活期友货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利活期友货币市场基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	120,564,216.89	100,786,992.16
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	635,550,546.94	417,069,865.69
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		635,550,546.94	417,069,865.69
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	367,085,073.63	180,370,630.56
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,923,880.43	2,048,999.96
应收股利		-	-
应收申购款		51,132.00	176,312.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,125,174,849.89	700,452,801.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		59,999,770.00	43,999,858.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		226,205.60	170,773.62
应付托管费		41,889.92	56,924.53
应付销售服务费		209,449.64	142,311.33
应付交易费用	6.4.7.7	32,856.14	29,507.27
应交税费		8,939.81	3,643.35
应付利息		5,161.51	1,843.72
应付利润		83,105.29	45,018.46
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	104,561.21	219,000.00
负债合计		60,711,939.12	44,668,880.28
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,064,462,910.77	655,783,920.93
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,064,462,910.77	655,783,920.93
负债和所有者权益总计		1,125,174,849.89	700,452,801.21

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,064,462,910.77 份，其中泰达宏利活期友货币 A 基金份额总额 1,064,462,910.77 份，基金份额净值 1.0000 元；泰达宏利活期友货币 B 基金份额总额 0.00 份，基金份额净值 1.0000 元。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利活期友货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		12,405,716.31	8,968,754.66
1. 利息收入		12,432,800.02	8,906,009.58
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,361,303.08	1,584,064.07
债券利息收入		7,562,043.31	6,232,483.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,509,453.63	1,089,461.64
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-27,083.71	62,745.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-27,083.71	62,745.08
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		2,810,355.34	2,713,461.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,108,852.04	1,055,713.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	205,342.92	351,904.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,026,714.76	872,170.41
4. 交易费用	6.4.7.19	-	50.00

5. 利息支出		323,094.19	283,542.74
其中：卖出回购金融资产支出		323,094.19	283,542.74
6. 税金及附加		3,634.40	2,629.09
7. 其他费用	6.4.7.20	142,717.03	147,451.78
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		9,595,360.97	6,255,293.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		9,595,360.97	6,255,293.32

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：泰达宏利活期友货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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)	655,783,920.93	-	655,783,920.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,595,360.97	9,595,360.97
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)	408,678,989.84	-	408,678,989.84
其中：1. 基金申购款	4,948,055,787.33	-	4,948,055,787.33
2. 基金赎回款	-4,539,376,797.49	-	-4,539,376,797.49
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)	-	-9,595,360.97	-9,595,360.97
五、期末所有者权益(基金净值)	1,064,462,910.77	-	1,064,462,910.77
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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)	843,620,306.88	-	843,620,306.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,255,293.32	6,255,293.32
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)	-279,385,909.96	-	-279,385,909.96
其中：1. 基金申购款	3,990,734,681.21	-	3,990,734,681.21
2. 基金赎回款	-4,270,120,591.17	-	-4,270,120,591.17
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)	-	-6,255,293.32	-6,255,293.32
五、期末所有者权益(基金净值)	564,234,396.92	-	564,234,396.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

傅国庆

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰达宏利活期友货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]9号《关于准予泰达宏利活期友货币市场基金募集的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利活期友货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 478,816,374.03 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 1238 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利活期友货币市场基金基金合同》于 2015 年 11 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

478,938,956.75 份基金份额，其中认购资金利息折合 122,582.72 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，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利活期友货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据和同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款税后利率。

#### 6.4.2 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〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利活期友货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度上半年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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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

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

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

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	564,216.89
定期存款	120,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	90,000,000.00

存款期限 3 个月以上	30,000,000.00
其他存款	-
合计	120,564,216.89

注：定期存款的存款期限指票面存期。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 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	635,550,546.94	636,023,000.00	472,453.06	0.0444
	合计	635,550,546.94	636,023,000.00	472,453.06	0.0444
资产支持证券		-	-	-	-
合计		635,550,546.94	636,023,000.00	472,453.06	0.0444

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。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产和负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	367,085,073.63	-
合计	367,085,073.63	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	101.42

应收定期存款利息	390,138.98
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	1,413,797.25
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	119,842.78
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	1,923,880.43

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	32,856.14
合计	32,856.14

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	104,561.21
合计	104,561.21

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰达宏利活期友货币 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	655,783,920.93	655,783,920.93
本期申购	4,948,055,787.33	4,948,055,787.33
本期赎回(以“-”号填列)	-4,539,376,797.49	-4,539,376,797.49
-基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,064,462,910.77	1,064,462,910.77

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

泰达宏利活期友货币 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	9,595,360.97	-	9,595,360.97
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	-9,595,360.97	-	-9,595,360.97
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	2,127.68
定期存款利息收入	1,359,175.40
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,361,303.08

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期未有股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债	-27,083.71

券到期兑付) 差价收入	
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	-27,083.71

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,677,735,185.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,674,285,649.55
减：应收利息总额	3,476,619.18
买卖债券差价收入	-27,083.71

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期末有公允价值变动收益。

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期末有其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

本基金本报告期末有交易费用。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	36,200.00
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	29,115.82



账户维护费	17,293.84
其他	600.00
合计	142,717.03

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期无或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国银行股份有限公司(中国银行)	基金托管人、基金代销机构

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 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方交易单元进行债券交易。

### 6.4.10.1.3 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方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 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方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,108,852.04	1,055,713.01
其中：支付销售机构的客户维护费	513,185.59	537,342.10

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 0.30%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×0.30%/当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	205,342.92	351,904.31

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利活期友货币 A	泰达宏利活期友货币 B	合计
泰达宏利基金管理有限公司	5,203.29	-	5,203.29
中国银行	11,503.39	-	11,503.39
合计	16,706.68	-	16,706.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利活期友货币 A	泰达宏利活期友货币 B	合计
泰达宏利基金管理有限公司	32,063.22	-	32,063.22
中国银行	23,941.95	274.67	24,216.62
合计	56,005.17	274.67	56,279.84

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年可比期间均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	564,216.89	2,127.68	10,436,371.18	3,897.22

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

泰达宏利活期友货币 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
9,557,274.14	-	38,086.83	9,595,360.97	-

#### 6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新股或增发而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 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 59,999,770.00 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
120306	12 进出 06	2021 年 7 月 1 日	101.30	10,000	1,013,033.62
200216	20 国开 16	2021 年 7 月 1 日	100.01	400,000	40,005,407.01
210206	21 国开 06	2021 年 7 月 1 日	99.95	200,000	19,989,943.01
合计				610,000	61,008,383.64

#### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 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。

##### 6.4.13.1 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。

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。

##### 6.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，定期存款存放在大连银行、哈尔滨银行、民生银行、厦门国际银行、招商永隆银行，因此与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，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。

#### 6.4.13.2.1 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	20,000,405.02	30,000,240.71
A-1 以下	-	-
未评级	130,002,411.43	69,852,035.42
合计	150,002,816.45	99,852,276.13

注：以上未评级的债券投资中包括超短期融资券等。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	415,422,044.27	237,258,797.81
合计	415,422,044.27	237,258,797.81

#### 6.4.13.2.4 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	70,125,686.22	79,958,791.75
合计	70,125,686.22	79,958,791.75

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。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 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。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、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，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2021年6月30日，除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种（企业债或短期融资券），并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，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 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 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；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时，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 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流



动性情况良好。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	90,564,216.89	30,000,000.00	-	-	120,564,216.89
交易性金融资产	448,752,915.36	186,797,631.58	-	-	635,550,546.94
买入返售金融资产	367,085,073.63	-	-	-	367,085,073.63
应收利息	-	-	-	1,923,880.43	1,923,880.43
应收申购款	-	-	-	51,132.00	51,132.00
资产总计	906,402,205.88	216,797,631.58	-	1,975,012.43	1,125,174,849.89
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	226,205.60	226,205.60
应付托管费	-	-	-	41,889.92	41,889.92
卖出回购金融资产款	59,999,770.00	-	-	-	59,999,770.00
应付销售服务费	-	-	-	209,449.64	209,449.64
应付交易费用	-	-	-	32,856.14	32,856.14
应付利息	-	-	-	5,161.51	5,161.51
应付利润	-	-	-	83,105.29	83,105.29
应交税费	-	-	-	8,939.81	8,939.81
其他负债	-	-	-	104,561.21	104,561.21

负债总计	59,999,770.00	-	-	712,169.12	60,711,939.12
利率敏感度缺口	846,402,435.88	216,797,631.58	-	1,262,843.31	1,064,462,910.77
上年度末 2020 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	100,786,992.16	-	-	-	100,786,992.16
交易性金融资产	298,621,412.43	118,448,453.26	-	-	417,069,865.69
买入返售金融资产	180,370,630.56	-	-	-	180,370,630.56
应收利息	-	-	-	2,048,999.96	2,048,999.96
应收申购款	-	-	-	176,312.84	176,312.84
资产总计	579,779,035.15	118,448,453.26	-	2,225,312.80	700,452,801.21
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	170,773.62	170,773.62
应付托管费	-	-	-	56,924.53	56,924.53
卖出回购金融资产 款	43,999,858.00	-	-	-	43,999,858.00
应付销售服务费	-	-	-	142,311.33	142,311.33
应付交易费用	-	-	-	29,507.27	29,507.27
应付利息	-	-	-	1,843.72	1,843.72
应付利润	-	-	-	45,018.46	45,018.46
应交税费	-	-	-	3,643.35	3,643.35
其他负债	-	-	-	219,000.00	219,000.00
负债总计	43,999,858.00	-	-	669,022.28	44,668,880.28
利率敏感度缺口	535,779,177.15	118,448,453.26	-	1,556,290.52	655,783,920.93

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的到期日予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 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(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	635,550,546.94	56.48
	其中：债券	635,550,546.94	56.48
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	367,085,073.63	32.62
	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	120,564,216.89	10.72
4	其他各项资产	1,975,012.43	0.18
5	合计	1,125,174,849.89	100.00

### 7.2 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	3.69	
	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	59,999,770.00	5.64
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中，报表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

本基金本报告期未出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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	80
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

### 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。

#### 7.3.2 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	46.74	5.64
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	16.87	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	12.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	25.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	105.52	5.64

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未出现超过 240 天的情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,125,686.22	6.59
	其中：政策性金融债	70,125,686.22	6.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	150,002,816.45	14.09
6	中期票据	-	-
7	同业存单	415,422,044.27	39.03
8	其他	-	-
9	合计	635,550,546.94	59.71
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

	券		
--	---	--	--

### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	012101972	21 鲁钢铁 SCP012	500,000	50,000,504.47	4.70
2	112006230	20 交通银行 CD230	500,000	49,906,813.97	4.69
3	112011189	20 平安银行 CD189	500,000	49,860,373.12	4.68
4	112106001	21 交通银行 CD001	500,000	49,211,733.63	4.62
5	112103054	21 农业银行 CD054	500,000	48,764,962.11	4.58
6	200216	20 国开 16	400,000	40,005,407.01	3.76
7	012102304	21 津城建 SCP027	200,000	20,000,671.12	1.88
8	072100099	21 东北证券 CP004	200,000	20,000,405.02	1.88
9	210206	21 国开 06	200,000	19,989,943.01	1.88
10	112180931	21 广州农村商业银行 CD049	200,000	19,919,169.47	1.87

### 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1396%
报告期内偏离度的最低值	-0.0372%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0522%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未出现达到 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

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未出现达到 0.5%的情况。

### 7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日计算当日收益并分配，每日支付收益，使基金帐面份额净值始终保持 1.00 元。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，平安银行于 2020 年 10 月 16 日曾受到宁波银保监局公开处罚，于 2021 年 5 月 28 日受到云南银保监局公开处罚，于 2021 年 5 月 11 日受到中国银保监会消费者权益保护局公开处罚，国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日曾受到中国银保监会公开处罚，农业银行于 2020 年 7 月 13 日、2020 年 12 月 7 日曾受到银保监会公开处罚。

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

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,923,880.43
4	应收申购款	51,132.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,975,012.43

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1. 由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
2. 报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份	持有人户	户均持有	持有人结构
---	------	------	-------

额 级 别	数（户）	的基金份 额	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 活 期 友 货 币 A	327,463	3,250.64	6,618,283.33	0.62	1,057,844,627.44	99.38
泰 达 宏 利 活 期 友 货 币 B	-	-	-	-	-	-
合 计	327,463	3,250.64	6,618,283.33	0.62	1,057,844,627.44	99.38

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）。

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	其他类机构	5,006,820.24	0.47
2	个人	3,196,270.37	0.30
3	个人	2,490,322.18	0.23
4	个人	2,274,682.87	0.21
5	个人	1,935,638.79	0.18
6	个人	1,838,726.56	0.17
7	个人	1,753,261.87	0.16
8	个人	1,606,584.17	0.15
9	个人	1,602,788.61	0.15
10	基金类机构	1,544,390.75	0.15

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰达宏利活期友货币 A	183,162.95	0.0172
	泰达宏利活期友货币 B	0.00	0.0000
	合计	183,162.95	0.0172

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	泰达宏利活期友货币 A	0~10
	泰达宏利活期友货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利活期友货币 A	-
	泰达宏利活期友货币 B	-
	合计	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利活期友货币 A	泰达宏利活期友货币 B
基金合同生效日 (2015 年 11 月 4 日) 基金份额总额	71,268,199.50	407,670,757.25
本报告期期初基金份额总额	655,783,920.93	-
本报告期基金总申购份额	4,948,055,787.33	-
减：本报告期基金总赎回份额	4,539,376,797.49	-
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	1,064,462,910.77	-



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本公司于 2021 年 2 月 23 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，自 2021 年 2 月 23 日起，由徐娇娇女士担任公司督察长。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。报告期内，公司收到北京证监局对公司采取警示措施的决定。公司已及时完成了整改，提升了内控水平。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期无交易单元变更。

（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，使用其交易单元作为基金的专用交

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。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

#### 10.8 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 备查文件目录

#### 11.1 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、营业执照；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

#### 11.2 存放地点

基金管理人和托管人住所。

#### 11.3 查阅方式

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

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 或 010-66555662。

泰达宏利基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日