泰达宏利货币市场基金

2013 年度 报告摘要

2013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:2014年3月27日

§1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人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2014年3月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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2013年1月1日起至2013年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利货币
基金主代码	162206
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年11月10日
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	156,736,411.87份
基金合同存续期	不定期

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	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	曹桢桢	李芳菲
	联系电话	010-66577728	010-66060069
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95599
传真		010-66577666	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http:/www.mfcteda.com
基金年度报告报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	18,155,806.25	19,292,879.00	5,708,803.49
本期利润	18,155,806.25	19,292,879.00	5,708,803.49
本期净值收益率	4.0442%	4.1688%	2.9591%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-	-	-
期末基金资产净值	156,736,411.87	311,758,605.18	87,565,824.24
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

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。

3.2 基金净值表现

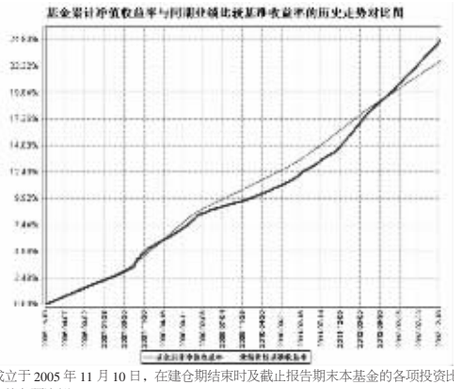
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.0688%	0.0029%	0.7562%	0.0000%	0.3126%	0.0029%
过去六个月	2.1049%	0.0026%	1.5123%	0.0000%	0.5926%	0.0026%
过去一年	4.0442%	0.0067%	3.0000%	0.0000%	1.0442%	0.0067%
过去三年	11.5881%	0.0068%	9.5253%	0.0007%	2.0628%	0.0061%
过去五年	15.1676%	0.0066%	14.0795%	0.0013%	1.0881%	0.0053%
自基金合同生效起至今	24.7643%	0.0066%	22.7733%	0.0019%	1.9910%	0.0047%

1.本基金收益分配按月结转份额。

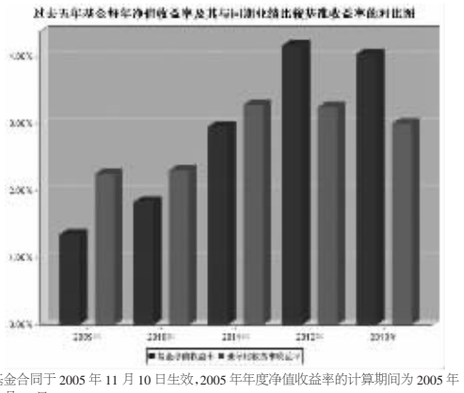
2.本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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



本基金基金合同于2005年11月10日生效,2005年年度净值收益率的计算期间为2005年11月10日至2005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

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
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	
2011	5,281,881.68	773,648.92	-346,727.11	5,708,803.49	
合计	34,920,870.95	8,291,774.94	-55,157.15	43,157,488.74	

§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基金、泰达宏利行业精选基金、泰达宏利风险预算混合型基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型基金、泰达宏利首选企业股票型基金、泰达宏利市值优选股票型基金、泰达宏利集利债券型基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型基金、泰达宏利红利先锋股票型基金、泰达宏利中证财富大盘指数型基金、泰达宏利领先中小盘股票型基金、泰达宏利聚利分级债券型基金、泰达宏利全球新格局基金(QDII-FOF)、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、泰达宏利信用合利定期开放债券型基金、泰达宏利高票息定期开放债券型基金、泰达宏利瑞利分级债券型基金在内的二十一只证券投资基金。

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	-	11	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,从事债券交易与研究工作,首席研究员;2006年3月至2006年6月就职于国联证券公司,从事债券交易工作,高级经理;2006年7月至2008年3月就职于益民基金管理有限公司,其中2006年7月至2006年11月任益民货币市场基金基金经理助理,2006年12月至2008年3月经理月任益民货币市场基金基金经理;2008年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司。11年证券从业经验,8年基金从业经验,具有基金从业资格。

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相关法律法规以及基金合同的约定,本基金运作整体合法合规,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程,严格执行相关制度规定。在投资管理活动中,公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会;在交易环节实行集中交易制度,交易部运用交易系统中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,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。

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。

4.3.3 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

2013年,受益于房地产市场复苏和消费的推动,美国终于在13年4季度揭开QE退出的序幕,QE退出对全球流动性,特别是对新兴市场国家流动性的影响已经在6月份提前预演了一番。中国经济总体平稳,通胀相对可控,利率市场化和控风险成为年内对货币市场和债券市场最关键的两大因素。

政策上,与世界其他主要大国继续实施宽松政策有所不同,新一届领导集体上台之后,中国的宏观政策发生了一些转变,控风险成为宏观调控的重要目标之一。5月10日,停发17个月之后,央行重启央票发行。6月,央行并没有像往常一样在银行间市场利率上升较快之时果断出手,更多的只是一再强调银行间总体流动性充裕。3季度央行继续锁长放短,4季度更是通过缩减常备借贷便利(SLF)规模等手段大幅对冲热钱流入,稳健货币政策中性偏紧。中性偏紧的货币政策使得货币市场利率整体较高,而同业资金的错配及规模急剧扩张加剧了资金紧张状况,使得在月末、季末等关键时点容易导致利率剧烈波动。2季度末起,互联网金融崛起,加快了银行存款搬家过程,进一步推高了无风险利率和放大了银行对资金的需求。

货币市场而言,5月底前,货币市场波动率有所下降,12年年底和春节期间央行细心呵护,银行间市场资金状况比较平稳。期间,除2月下旬因为财政缴款等因素叠加,银行间资金较为紧张之外,回购利率维持低位。进入6月份之后,尽管银行体系总体备付金仍处于较高水平,但各机构普遍感到资金非常紧张,R007最高到过28%的水平。受资金利率大幅飙升影响,短债收益率大幅跳升200-500bp,大大超出市场的预期。3季度由于央行锁长放短,整体资金平稳,短债收益率小幅波动。国庆之后,央行开始通过公开市场等方式回笼流动性,超出市场预期,回购利率和短债收益率大幅上行。全年国开债和高等级短期融资券收益率超过上行200bp,低等级短融上行幅度在300-400bp,而且资质差异导致同一评级的短融收益率分化加剧。

操作上,本基金1-6月份操作相对积极,增持了较多较长久期的短期融资券和利率债,整体组合剩余期限较高,比较符合市场走势。6月份之后操作相对谨慎,但由于基金规模萎缩较为严重,下半年基金运作较为艰难,收益率比到较大影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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4.0442%,同期业绩比较基准增长率为3.0000%。

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2014,央行继续实施稳健的货币政策,既不放松也不收紧银根,进一步推进利率市场化改革,把握好稳增长、调结构、促改革、防风险的平衡点。与13年相似,控风险将持续,短期内货币市场将继续面临13年类似的状况,利率市场化和央行去杠杆对货币市场和债券市场的冲击将继续。除了继续面对形形色色的互联网金融创新对资金的冲击外,2014年还将面临IPO开闸、美国QE进一步退出等对货币市场的冲击。另外,部分行业、企业的信用风险将有可能暴露,而支撑非标市场畸形膨胀的隐性担保、刚性兑付等也有望在年内有所改变,信用风险管理需要强化。总体而言,经过2013年的大幅调整,短债市场孕育着机会,但需积极关注政策的变化以及更加重视信用风险。

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运营的副总经理负责,成员包括督察长、投资总监、基金经理及研究部、交易部、固定收益部、监察稽核部、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。本公司参与估值流程各方之间没有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。

4.7 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2013年累计分配收益18,155,806.25元,已于每月中旬集中转结至基金持有人账户。

§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2013年1月1日至2013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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

本基金2013年年度报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

§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:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	39,241,990.30	60,522,102.17
结算备付金	-	63,636.36
存出保证金	-	-
交易性金融资产	79,665,626.34	180,521,547.14
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	79,665,626.34	180,521,547.14
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	50,100,395.15	100,000,350.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,548,397.44	4,130,045.80
应收股利	-	-
应收申购款	909,159.87	18,600.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	171,465,569.10	345,256,281.47
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	13,719,873.14	32,049,783.97
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	50,658.81	154,032.83
应付托管费	15,351.16	46,676.58
应付销售服务费	38,377.89	116,691.48
应付交易费用	9,682.06	17,617.14
应交税费	51,309.84	51,309.84
应付利息	1,266.28	3,452.19
应付利润	491,192.05	988,218.76
递延所得税负债	-	-
其他负债	351,446.00	69,893.50
负债合计	14,729,157.23	33,497,676.29
所有者权益:		
实收基金	156,736,411.87	311,758,605.18
未分配利润	-	-
所有者权益合计	156,736,411.87	311,758,605.18
负债和所有者权益总计	171,465,569.10	345,256,281.47

报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.00元,基金份额总额156,736,411.87份。

7.2 利润表

会计主体:泰达宏利货币市场基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	22,346,607.29	23,429,902.76
1.利息收入	20,882,054.29	20,378,292.99
其中:存款利息收入	2,986,065.32	2,890,328.49
债券利息收入	11,083,582.84	12,383,829.27
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	6,812,406.13	5,104,135.23
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,464,553.00	3,051,609.77
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,464,553.00	3,051,609.77
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	4,190,801.04	4,137,023.76
1.管理人报酬	1,564,741.44	1,650,161.23
2.托管费	474,164.11	500,048.81
3.销售服务费	1,185,410.42	1,250,122.08
4.交易费用	-	-
5.利息支出	540,363.53	300,824.59
其中:卖出回购金融资产支出	540,363.53	300,824.59
6.其他费用	426,121.54	435,867.05
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	18,155,806.25	19,292,879.00
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	18,155,806.25	19,292,879.00

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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	87,565,824.24	-	87,565,824.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,292,879.00	19,292,879.00
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)	224,192,780.94	-	224,192,780.94
其中:1.基金申购款	4,488,628,117.12	-	4,488,628,117.12
2.基金赎回款	-4,264,435,336.18	-	-4,264,435,336.18
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)	-	-19,292,879.00	-19,292,879.00
五、期末所有者权益(基金净值)	311,758,605.18	-	311,758,605.18

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《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额存单,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2014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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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2013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2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无会计政策变更、会计估计变更或重大会计差错。

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,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 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(中国农业银行")	基金托管人、基金代销机构
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
宏利资产管理(香港)有限公司	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,564,741.44	1,650,161.23
其中:支付销售机构的客户维护费	368,394.79	463,338.53

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%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值x0.33%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	474,164.11	500,048.81

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。

7.4.8.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 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	
泰达宏利基金管理有限公司	224,141.54	
中国农业银行	141,349.19	
合计	365,490.73	
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
泰达宏利基金管理有限公司	74,653.66	
中国农业银行	178,800.06	
合计	253,453.72	

支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,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。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值x0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	50,413,334.93	50,280,356.16	-	-	110,300,000.00	12,183.38
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	50,250,156.71	159,461,650.54	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用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。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年12月31日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国农业银行涟源市支行	274.03	0.0002%	264.69	0.0001%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	241,990.30	33,782.80	522,102.17	48,730.80

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末2013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13,719,873.14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
100230	10国开30	2014年1月2日	99.19	140,000	13,886,600.00
合计				140,000	13,886,600.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

§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	79,665,626.34	46.46
	其中:债券	79,665,626.34	46.46
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	50,100,395.15	29.22
	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	39,241,990.30	22.89
4	其他各项资产	2,457,557.31	1.43
5	合计	171,465,569.10	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	3.61	
	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	13,719,873.14	8.75
	其中:买断式回购融资	-	-

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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	159
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	60

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	41.05	8.75
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	18.99	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	18.99	-
3	60天(含)-90天	6.38	-