# Disclosure 信息披露

#### 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

《1 重要提示

1.1里安提示 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。本半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根据本基金合同规定,于2015年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、和销分配情况、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 过程。以是使性企业企业专工。

15则分往的小学服表观、外间为在16元,则分类11 农石、农业组合农石等内各、床证支收内各个仔生原应 过载、误导性除述或者重大遗漏。 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。

平报日前为及四六正甲川。 本报告期自2015年1月1日起至2015年6月30日止。 本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。 《2.基本简介

+ . + .	a Loke NTT	》2 基並同川			
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	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份額总额		1,707,364,211.10份	1,707,364,211.10份		
基金合同存续期		不定期	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	189,071,303.69分	1,518,292,907.41份		
2.2 基金产品	说明				
投资目标	在确保本金岁	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	本基金将在追 析为基础,数 期偏离、收益	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调解和目下而上个参选择的程序,运用供求分析,久期偏高,改造单能线配置新水流配置等积极投资资格,实现基金资产的保值增值。			
n Admit Alaski sin	OUT AT BOOK	t der als directoristis district			

2.3 基金管理	人和基金托管/			
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	
	姓名	陈沛	林葛	
信息披露负责人	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	
2.4 信息披露	方式			

本基金属于证券投资基金中高流动性 型基金和债券型基金。

基金级别	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日
本期已实现收益	4,593,282.32	21,874,326.4
本期利润	4,593,282.32	21,874,326.4
本期争值收益率	2.1128%	2.23439
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6	5月30日)
期末基金资产净值	189,071,303.69	1,518,292,907.4
期末基金份額净值	1.0000	1.000

相关费用后的余额,本期的限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、计人费用后实际收益水平要低于所列数字

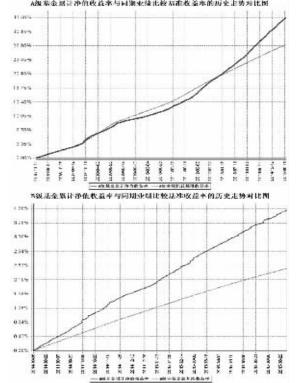
本基金收益分配按月结转份额

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

			% K K K M D	J1 J2%		
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	0.3333%	0.0136%	0.1829%	0.0002%	0.1504%	0.0134%
过去三个月	0.9639%	0.0095%	0.5863%	0.0004%	0.3776%	0.0091%
过去六个月	2.1128%	0.0095%	1.2432%	0.0006%	0.8696%	0.0089%
过去一年	4.3505%	0.0086%	2.7281%	0.0007%	1.6224%	0.0079%
过去三年	13.2687%	0.0072%	8.7315%	0.0006%	4.5372%	0.0066%
自基金合同生效 起至今	33.4747%	0.0071%	26.9890%	0.0017%	6.4857%	0.0054%
			泰达宏利货	f币B	•	
阶段	份额争值收益 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	0.3530%	0.0136%	0.1829%	0.0002%	0.1701%	0.0134%
过去三个月	1.0243%	0.0095%	0.5863%	0.0004%	0.4380%	0.0091%
过去六个月	2.2343%	0.0095%	1.2432%	0.0006%	0.9911%	0.0089%
自基金合同生效 起至今	4.1535%	0.0090%	2.4322%	0.0007%	1.7213%	0.0083%

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级基金器计净值收益率与同衡业绩比较基准收益率的历史上势对比例



注:本基金成立于2005年11月10日,本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到

§ 4 管理人报告 4.1 基金管理人及基金经理情况

型证券投资基金在内的三十多只证券投资基金。

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	说明	
XDEI	8/1/20	任职日期	离任日期	年限	10093	
丁宇佳	本基金基金经理	2015年3月26日	-	7	理学学士:2006年7月加入泰达索列 基金管理者限心。引起任务制定 易员、负责债券交易工作:2013年9月 至2014年9月,担任届近收益部研究 员、从事情券研究工作:2014年10月 至2015年2月,担任届近收益部基金 经理助理具条67年基金从业经验7, 年证券投资管理经验。具有基金从 业资格。	
胡椒仓	本基金基金经理	2009年5月23日	2015年6月11日	12	金融等额十、2003年7月至2005年4 月就原于乌森外末市商业保护、 事债券交易与研究工作。首席研究于 15、2006年3月至2005年6月前原于 国际企业分司、从事债券交易。[15、 设置于各股金管理有限公司,其 中2006年7月至2006年1月任益股份 市市场涨金差经理助理。2006年1月至2008年1月至2008年3月在经股份市场蒸发 有限金管理有限公司,其7年证券从 规定整合,4年基金管理用度公司。4年基金管理,19年证券从	

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

深下、可时心,得核、可存实;交易的运角交易系统干权重的公平交易为能升按照的同机完,仍格优完的原则严格执行所有指令、未发生任何和益输送的情况。
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。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%。在本报告期内基金投资策略和业绩表现的说明
4.4 管理人对报告期内基金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
2015年上半年,美国经济从底部走出,房地产价格和劳动者收入进人上行通道,美联储态度较市场预期隔涨,加息时点可能延展到9月联储会议期间。欧洲经济较据持续小幅好转。国内经济下行压力不或,中微观数据显示工业生产企稳的基础并不牢固、基建投资保持较高增速,制造业投资被弱,房地产销售有所好转,消费较为稳定、贸易顺差维持衰退式高位;PPI同比跌幅继续扩大,肉类价格上扬对它P形成支撑。受到下半年基数较低影响。6月CPI或达到年内低点;则成方面,地方按价债股量分后,国务策继续加大财政投放力度;央行进行多次降准降息操作,并采用逆回购,MLF、PSL等工具提供流动性。 债券市场方面,新股IPO造成短端收益率的明显波动,中短期限品种收益率波段下行,长端受制于地方债的放量,保持高位窄幅震荡。收益率曲线陡峭化。

## 泰达宏利货币市场基金

## 2015 半年度 报告摘要

#### 2015年6月30日

操作上,本基金采取相对弹性的投资策略,保持中性久期,在收益率箱体震荡期间,积极进行波段 ;适当增加债券配置降低存款比例。 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2.1128%,同期业绩比较基 准增长率为1.2432%

後市B 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2.2343%,同期业绩比较基

级短融配置,保持中性的久期策略,利用高评级短融和短久期回购保持组合的流动性,继续进行积极的

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

48报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产单值预警情形的说明 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

\$5 托管人报告 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信请见声明 在托管泰达宏利货币市场基金的过程中,本基金托管人一中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《泰达宏利货币市场基金金基金合同》、《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管理人一泰达宏利基金管理有限公司2015年1月1日至2015年6月30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。
52 托管人式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、基金费用开支及利润分配等问题上、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

格按照基金合同的规定进行。
5.3 托管人对本半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基金半年度报告中的
财务指标、净值表观、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半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:泰达宏利货币市场基金

资产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:		
银行存款	50,388,973.91	110,294,767.6
结算备付金	2,054,990.00	465,000.0
存出保证金	=	
交易性金融资产	1,531,008,578.19	753,761,181.9
其中:股票投资	-	
基金投资	=	
债券投资	1,531,008,578.19	753,761,181.9
资产支持证券投资	-	
贵金属投资	=	
衍生金融资产	-	
买人返售金融资产	218,100,847.15	47,800,281.7
应收证券清算款	-	
立收利息	19,577,554.00	20,784,662.3
立收股利	-	
立收申购款	21,221,666.09	500.0
递延所得税资产	-	
其他资产	15,000.00	
资产总计	1,842,367,609.34	933,106,393.6
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负债:		
短期借款	-	
交易性金融负债	=	
行生金融负债	=	
卖出回购金融资产款	129,999,735.00	135,399,596.9
立付证券清算款	=	
立付赎回款	-	
立付管理人报酬	589,106.98	424,238.9
立付托管费	178,517.27	128,557.2
立付销售服务费	55,043.13	82,160.7
立付交易费用	60,329.73	67,672.3
立交税费	51,309.84	51,309.8
立付利息	4,538.97	14,956.0
立付利润	3,873,223.18	1,415,573.3
递延所得税负债	-	
其他负债	191,594.14	97,130.0
负债合计	135,003,398.24	137,681,195.4
<b>折有者权益</b> :		
实收基金	1,707,364,211.10	795,425,198.2
	-	
未分配利润		
未分配利润 所有者权益合计	1,707,364,211.10	795,425,198.20

会计主体:泰达宏利货币市场基金 本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收人	31,346,373.12	17,018,693.69
1.利息收入	22,916,718.21	14,334,465.25
其中:存款利息收入	2,405,022.63	3,330,827.90
债券利息收人	12,924,426.37	7,082,419.31
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收人	7,587,269.21	3,921,218.04
其他利息收人	-	
2.投资收益 假失以 ""填列)	8,412,838.73	2,684,228.44
其中:股票投资收益	-	
基金投资收益	-	-
债券投资收益	8,412,838.73	2,684,228.44
资产支持证券投资收益	-	
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益 假失以 ""号填列)	-	-
4.汇兑收益 假失以 ""号填列)	-	-
5.其他收入 假失以 ""号填列)	16,816.18	-
减:二、费用	4,878,764.36	2,693,365.59
1.管理人报酬	2,096,259.07	998,774.43
2.托管费	635,230.03	302,658.91
3.销售服务费	325,471.91	756,647.38
4.交易费用	-	-
5.利息支出	1,587,249.31	416,615.28
其中:卖出回购金融资产支出	1,587,249.31	416,615.28
6.其他费用	234,554.04	218,669.59
三、利润总额(亏损总额以""号填列)	26,467,608.76	14,325,328.10
减:所得税费用	-	-
四、净利润(争亏损以""号填列)	26,467,608.76	14,325,328.10

会计主体:泰达宏利货币市场基金

本报告期:2015年1月1日 3	È 2015年6月30日		单位:人民币		
頂目	2015	本期 年1月1日至2015年6月30日	十世:八八八川		
	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)	795,425,198.26	-	795,425,198.20		
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期净利润)	-	26,467,608.76	26,467,608.76		
三、本期基金份额交易产生的基 金净值变动数 (争值减少以""号填列)	911,939,012.84	-	911,939,012.84		
其中:1.基金申购款	5,261,492,508.62	-	5,261,492,508.62		
2.基金赎回款	-4,349,553,495.78	-	-4,349,553,495.78		
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)	=	-26,467,608.76	-26,467,608.70		
五、期末所有者权益(基金净值)	1,707,364,211.10	-	1,707,364,211.10		
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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 (株金净值)	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(本期净利润)	-	14,325,328.10	14,325,328.10		
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)	913,915,185.26	=	913,915,185.26		
其中:1.基金申购款	3,951,962,075.35	-	3,951,962,075.35		
2.基金赎回款	-3,038,046,890.09	=	-3,038,046,890.09		
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)	=	-14,325,328.10	-14,325,328.10		
五、期末所有者权益(基金净值)	1,070,651,597.13	-	1,070,651,597.13		

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署: 

6.4.1 基金基本情况 泰达宏利货币市场基金(以下简称"本基金",原湘财商银货币市场基金,后更名为泰达商银货币市场基金)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4.643.264,422.55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安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日更名为参达荷银货币市场基金。根据本基金的基金管程入2010年3月17日发布的《泰达索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能改基金合同、招募说明书和托管协议的公告》,自2014年8月6日起、本基金根据特咨者并有的基金的产额数量级别将基金价额分为人类和B类、不同级别

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。招募说明书和任管协议的公告为。 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。 本财本保护者,本基金的基金管理人泰达宏和基金管理有限公司于2015年8月5日批准报出。 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8月25日批准报出。

0.42 云门水色的编码逻辑 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XRRL模板第3号~年度报告和华年度报告 >》,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6.4.4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

6.4.5 会计数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 本基金管理人于2015年3月28日发布《关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》, 自2015年3月27日起,本基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。 除上述会计估计变更事项外,本报告期未发生其他会计估计变更。 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。

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》、则 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

: (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

(1)以及11金型人公司 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

(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。 6.47 关联方关系 6.47.1 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。 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

单位:人民币元

04-04-1 超度/永沙/ 文/9年/02/11/19文/96 64.8.1.1 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方交易单元进行股票交易。 6.4.8.1.2 储券交易 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。

6.4.8.1.3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方交易单元进行债券回购交易。

本基金本区市别及上午度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。 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。

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。 6482 关联方积酬

6.4.8.2.1 基金管理费		单位:人民币:
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,096,259.07	998,774.43
其中:支付销售机构的客户维护费	158,236.20	146,771.08
		根酬按前一日基金资产净值0.33%的年 管理人报酬=前一日基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 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,逐日累让

6.4.8.2.3 销售服务费			单位:人民币:
获得销售服务费的	20	本期 015年1月1日至2015年6月30日	
各关联方名称	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	19,540.20	35,803.68	55,343.88
中国农业银行股份有限公司	16,368.89	-	16,368.89
合计	35,909.09	35,803.68	71,712.77
获得销售服务费的	21	上年度可比期间 014年1月1日至2014年6月30日	
各关联方名称	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	362,678.01	=	362,678.01
中国农业银行股份有限公司	48,844.61	-	48,844.61
合计	411,522.62	-	411,522.62

		2015年1月1	本期 日至2015年6月3	0⊟		
银行间市场交易的	债务	交易金额	基金i	逆回购	基金正	三回购
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	-	-
		上年 2014年1月1	度可比期间 日至2014年6月3	<b>0</b> Π		
银行间市场交易的	债务	交易金额	基金)	逆回购	基金正	三回购
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收人	交易金額	利息支出
中国农业银行	-	30,042,230.14	-	-	-	-
6.4.8.4 各关联) 6.4.8.4.1 报告期		的情况 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。 64.84.2 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

关联方名称	本期 2015年6	末 月 <b>30</b> 日	上年度 2014年12	末 月31日
大吹刀石桥	持有的 基金份额	持有的基金份額 占基金总份額的比例	持有的 基金份額	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	291.58	0.0002%	286.22	0.0001
泰达宏利民生加银 定向增发1号资产 管理计划	2,686,609.56	1.4210%	=	
泰达宏利鼎新交通 银行定向增发1号 资产管理计划	1,895,652.69	1.0026%	-	

市场基金B类基金份额。 6.4.8.5 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:
关联方 名称		库期 至2015年6月30日		可比期间 E2014年6月30日
4000	期末余额	当期利息收入	期末余額	当期利息收入
国农业银行	388,973.91	292,733.16	809,563.83	24,452.62
主:本基金的	的银行存款由基金托	管人中国农业银行保	管,按约定利率计息。	
5.4.8.6 本基	金在承销期内参与	关联方承销证券的情况	2	

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。

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。
6.4.8.7 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均无须作说明的其他关联交易事项。
6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期未无团人购新股或增发而于期末持有的流通受限证券。
6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
本基金本报告期未未持有暂时停牌等流通受限股票
6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购费。6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购费。6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购资易形成的卖出回购证券
金额10.00.07.32 00.5. 里以即工保益类量。15.40

					金额单位:人民向
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	2015年7月1日	100.40	300,000	30,120,000
130212	13国开12	2015年7月1日	98.63	300,000	29,589,000
140230	14国开30	2015年7月1日	100.48	200,000	20,096,000
150206	15国开06	2015年7月1日	100.92	200,000	20,184,000
150211	15国开11	2015年7月1日	100.35	300,000	30,105,000
合计				1,300,000	130,094,000

6.49.32 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。 6.4.10 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。

序号	项目	金額	金额单位:人民币 占基金总资产的比例 66)
1	固定收益投资	1,531,008,578.19	83.10
	其中:债券	1,531,008,578.19	83.1
	资产支持证券	-	
2	买人返售金融资产	218,100,847.15	11.8
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	
3	银行存款和结算备付金合计	52,443,963.91	2.8
4	其他各项资产	40,814,220.09	2.2
5	合计	1,842,367,609.34	100.0

7.2	灰分巴州 (	金额	i单位:人民币元
序号	项目	占基金资产净值的比例 66)	
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	金額	占基金资产净值 的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	129,999,735.00	7.61
	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 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

15.454			111111111111111111111111111111111111111	
序号	发生日期	融资余额占基金 资产净值比例 (%)	原因	调整期
	2015年6月16日	21.68	大額赎回	2015年6月23日调整完毕
	2015年6月17日	38.96	大額赎回	2015年6月23日调整完毕
	2015年6月18日	30.26	大額赎回	2015年6月23日调整完毕
	2015年6月19日	30.89	大額赎回	2015年6月23日调整完毕
	女人打冷加人 正均到。	A Harri		

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	160
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	160
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

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。 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	11.25	7.61
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	22.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.74	-
3	60天(含)—90天	9.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	21.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天 (含)	40.42	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	105.52	7.61

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

		ŝ	並额毕位:人氏巾刀
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	149,765,914.04	8.77
	其中:政策性金融债	149,765,914.04	8.77
4	企业债券	=	-
5	企业短期融资券	1,381,242,664.15	80.90
6	中期票据	=	-
7	其他	=	-
8	合计	1,531,008,578.19	89.67
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	29,652,731.29	1.74
注:	咐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

7.5 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	041563006	15首钢CP001	1,000,000	100,345,499.28	5.88
2	041477001	14蓝色光标 CP001	600,000	60,343,745.21	3.53
3	041460106	14海沧投资 CP002	600,000	60,206,190.12	3.53
4	071542004	15西部证券 CP004	600,000	60,048,704.12	3.52
5	011537006	15中建材 SCP006	600,000	59,993,547.06	3.51
6	011599079	15深投控 SCP001	500,000	50,134,819.46	2.94
7	011470007	14赣高速 SCP007	500,000	50,119,835.79	2.94
8	071501005	15招商CP005	500,000	49,995,586.34	2.93
9	071511006	15国信证券 CP006	500,000	49,992,212.54	2.93
10	041572008	15绵阳投控 CP001	500,000	49,977,827.24	2.93

/.b 影丁疋川 ¬ 推示队平伝 明疋的基並页厂	伊温的偏离
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	57
报告期内偏离度的最高值	0.4055%
报告期内偏离度的最低值	-0.0060%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2403%
7.7 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明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买人成本列示,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。

本基金本报告期內没有持有剩余期限小于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。

本基金本报告期内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。 7.8.4 期末其他各项资产构成

		甲位:人民用刀
序号	名称	金額
1	存出保证金	=
2	应收证券清算款	=
3	应收利息	19,577,554.00
4	应收申购款	21,221,666.09
5	其他应收款	15,000.00
6	待摊费用	=
7	其他	=
8	合计	40,814,220.09
7.0	北次加入中华以上的甘油子会带生动门	

由于四舍五人的原因,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:
				持有人结	吉构	
分額級 別	持有人户数	户均持有的基金份额	机构投资者		个人投资者	ž.
	( )		持有份額	占总份额比例	持有份額	占总份额比例
泰达宏 利货币 A	15,222	12,420.92	7,938,670.41	4.20%	181,132,633.28	95.80%
泰达宏 利货币 B	25	60,731,716.30	1,469,694,823.43	96.80%	48,598,083.98	3.20%
计	15,247	111,980.34	1,477,633,493.84	86.54%	229,730,717.26	13.46%

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)。 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份額级别	持有份额总数 (分)		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	262,409.57		0.1388%		
	泰达宏利货币B	0.00		0.0000%		
	合计	262,409.57		0.0154%		
8.4 期末基金管理人的从』	L人员持有本开放	文式基金	份额总量区间的情况	兄		
項目	份額级别		持有基金份额	总量的数量区间(万份)		
本公司高級管理人员、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		
	§9 开放	式基金	分额变动			

		单位:份
	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
金合同生效日 2005年11月10日 )基金份额总额	4,643,264,492.55	-
报告期期初基金份额总额	251,294,109.86	544,131,088.40
报告期基金总申购份额	806,363,771.46	4,455,128,737.16
:本报告期基金总赎回份额	868,586,577.63	3,480,966,918.15
报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	189,071,303.69	1,518,292,907.41
and the second s	T 1 + W 10 -	

10.1 基金份额持有人大会决议

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 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉 10.4 基金投资策略的改变 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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 1.本报告期基金管理人未受到任何稽查或处罚。?? 2.本报告期内,本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况 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 备注 成交金額

(一) 本报告期本基金未新增、撤销席位; 二)交易席付选择的标准和程序 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席

位,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。 1072 基金和用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

10.7.2 2630	(HI/HIII/MI)	(列平/加起门共)	PMT-XX-1X-1X-1X-1X-1X-1X-1X-1X-1X-1X-1X-1X-	HUL	金额单	单位:人民币元
	债券交易		债券回购交易		权证交易	
券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券回 购 成交总额的比 例	成交金額	占当期权证 成交总额的比 例
中银国际	-	-	534,900,000.00	50.60%	-	-
渤海证券	1	-	522,162,000.00	49.40%	-	-

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

泰达宏利基金管理有限公司 2015年8月25日