基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:北京银行股份有限公司
送出日期:2019年8月24日

# 泰达宏利京元宝货币市场基金

## 2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

§1 重要提示

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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月22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2019年1月1日起至2019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 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 泰达宏利京元宝货币 | |
| 基金主代码 | 003711 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年11月23日 | |
| 基金管理人 | 泰达宏利基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 北京银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 13,986,642,179.56份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 泰达宏利京元宝货币A | 泰达宏利京元宝货币B |
| 下属分级基金的交易代码: | 003711 | 003712 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 212,330,674.82份 | 13,774,311,504.74份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险,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 | 北京银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 聂志刚 | 刘晔 |
| | 联系电话 | 010-66577678 | 010-66226695 |
| | 电子邮箱 | irm@mfcteda.com | liuye1@bankofbeijing.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-698-8888 | 95526 |
| 传真 | | 010-66577666 | 010-66226045 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http:// www.mfcteda.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

§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

| 基金级别 | 泰达宏利京元宝货币A | 泰达宏利京元宝货币B |
|---|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年1月1日-2019年6月30日) | 报告期(2019年1月1日-2019年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 3,548,837.54 | 177,695,696.77 |
| 本期利润 | 3,548,837.54 | 177,695,696.77 |
| 本期净值收益率 | 1.3078% | 1.4288% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) | |
| 期末基金资产净值 | 212,330,674.82 | 13,774,311,504.74 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 |

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。

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

泰达宏利京元宝货币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 | 0.2094% | 0.0009% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0984% | 0.0009% |
| 过去三个月 | 0.6285% | 0.0010% | 0.3366% | 0.0000% | 0.2919% | 0.0010% |
| 过去六个月 | 1.3078% | 0.0011% | 0.6695% | 0.0000% | 0.6383% | 0.0011% |
| 过去一年 | 2.8663% | 0.0014% | 1.3500% | 0.0000% | 1.5163% | 0.0014% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.6062% | 0.0021% | 3.5137% | 0.0000% | 6.0925% | 0.0021% |

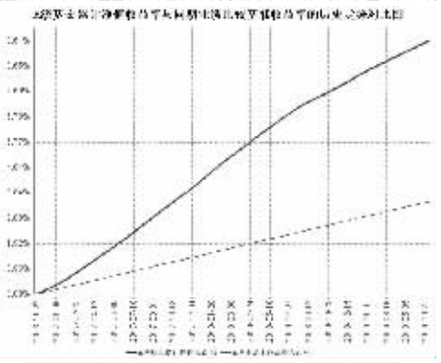
泰达宏利京元宝货币B

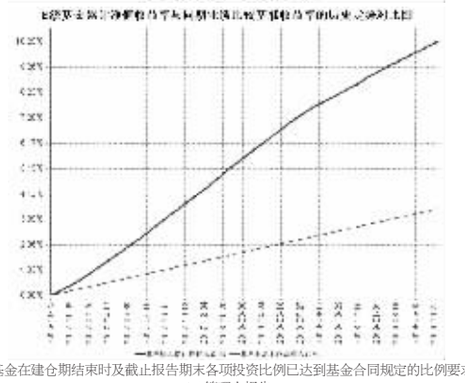
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.2292% | 0.0009% | 0.1110% | 0.0000% | 0.1182% | 0.0009% |
| 过去三个月 | 0.6889% | 0.0010% | 0.3366% | 0.0000% | 0.3523% | 0.0010% |
| 过去六个月 | 1.4288% | 0.0011% | 0.6695% | 0.0000% | 0.7593% | 0.0011% |
| 过去一年 | 3.1137% | 0.0014% | 1.3500% | 0.0000% | 1.7637% | 0.0014% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.2947% | 0.0021% | 3.5137% | 0.0000% | 6.7810% | 0.0021% |

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





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、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、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金、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)、泰达宏利年年添利定期开放债券型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 | | |
| 丁宇佳 | 本基金基金经理;固定收益部总经理 | 2016年11月23日 | - | 11 | 中央财经大学理学学士;2008年7月加入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、基金经理助理、基金经理、固定收益部总经理兼基金经理等职;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。 |
| 王靖 | 本基金基金经理助理,固定收益部副总经理 | 2017年3月8日 | 2019年3月29日 | 12 | 澳大利亚国立大学财务管理硕士;2007年11月至2010年3月,任职于华夏基金管理有限公司基金运作部,担任基金会计;2010年3月至2012年3月,任职于华融证券股份有限公司资产管理部,担任投资经理;2012年3月至2014年4月,任职于国盛证券有限责任公司资产管理总部,担任投资经理;2014年5月至2016年6月,任职于北信瑞丰基金管理有限公司,担任固定收益部总监兼基金经理;2016年6月至2016年10月,任职安邦基金管理有限公司(筹),担任固定收益投资部副总经理;2016年11月加入泰达宏利基金管理有限公司,现任固定收益部副总经理兼基金经理;具备12年证券从业经验,具有基金从业资格。 |
| 李祥源 | 本基金经理助理 | 2019年6月19日 | - | 4 | 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,现任基金经理助理,具备4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

报告期内,全球经济明显放缓,悲观预期继续抬升,主要经济体货币政策已趋向宽松,美国经济已现疲弱态势,美联储下半年降息概率增加,加之贸易摩擦背景,全球避险情绪抬头。国内方面,一季度金融数据见底企稳,融资环境出现改善,但是二季度受到包商银行被托管等事件影响,信用扩张的趋势有一定程度的放缓。受地方专项债可以用作合格重大基建项目资本金政策的影响,基建投资仍然起到较为关键的托底作用,但土地成交数据不足以支撑地产投资维持在合意水平,低盈利也限制了实体经济进行固定资产投资的意愿,一季度中美贸易谈判曾经显示似乎进入佳境,但二季度出现重大转折,影响较为深远。

债券市场在一月走完了上半年最大的行情,4月经历整整一个月的下跌,5月6月收复部分失地,总体曲线仍然稍显陡峭。5月底爆发包商银行事件,债券市场迅速发酵,造成部分金融机构短期流动性紧张,虽然事后央行表示维稳意愿,但同业负债的滚动和市场信心的恢复仍面临考验,信用利差明显走阔。

报告期内,我们仍认为央行的货币政策不会短时间内转向,低利率大概率是长期逻辑,二季度末央行对资金面的呵护意愿尤为明显,但出于流动性考量和防范黑天鹅事件,我们投资风格更加谨慎,在满足监管指标的前提下,我们更侧重对银行存单和回购的配置,增加组合流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期泰达宏利京元宝货币A的基金份额净值收益率为1.3078%,本报告期泰达宏利京元宝货币B的基金份额净值收益率为1.4288%,同期业绩比较基准收益率为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,我们认为外部环境的不确定性仍在,国内基建的一枝独秀难以带动经济的全面企稳,资金面宽松预期仍在,但在目前绝对收益率较低的位置上,投资上仍然以谨慎为主,以高流动性为投资首要目的。

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,本基金托管人在托管泰达宏利京元宝货币市场基金(以下称"本基金")的过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,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,本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核,对本基金的投资运作进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、收益分配情况、投资组合报告的内容(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分,以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内),保证复核内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§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:泰达宏利京元宝货币市场基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 2,205,256,889.21 | 2,053,386,538.59 |
| 结算备付金 | 2,600,000.00 | 1,818,181.82 |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 6,791,044,682.53 | 5,132,124,383.11 |
| 其中:股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 6,791,044,682.53 | 5,132,124,383.11 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 4,927,040,070.57 | 3,352,914,429.36 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 66,418,120.72 | 50,006,420.03 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 194,485.11 | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 13,992,554,248.14 | 10,590,249,952.91 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018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 | - | 479,398,920.90 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 1,881,237.71 | 1,325,904.64 |
| 应付托管费 | 527,079.21 | 441,968.22 |
| 应付销售服务费 | 148,216.84 | 163,003.68 |
| 应付交易费用 | 219,766.78 | 205,456.92 |
| 应交税费 | 122,340.26 | 48,168.45 |
| 应付利息 | - | 282,159.68 |
| 应付利润 | 3,171,361.77 | 4,091,038.97 |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 142,066.01 | 439,000.00 |
| 负债合计 | 5,912,068.58 | 486,395,621.46 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 13,986,642,179.56 | 10,103,854,331.45 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 13,986,642,179.56 | 10,103,854,331.45 |
| 负债和所有者权益总计 | 13,992,554,248.14 | 10,590,249,952.91 |

注:报告截止日2019年6月30日,泰达宏利京元宝货币A基金份额净值1.0000元,基金份额总额212,330,674.82份;泰达宏利京元宝货币B基金份额净值1.0000元,基金份额总额13,774,311,504.74份。泰达宏利京元宝货币份额总额合计为13,986,642,179.56份。

6.2 利润表

会计主体:泰达宏利京元宝货币市场基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 201,249,995.28 | 247,986,249.27 |
| 1.利息收入 | 206,058,378.42 | 249,867,323.78 |
| 其中:存款利息收入 | 45,649,523.58 | 104,885,529.93 |
| 债券利息收入 | 100,649,242.83 | 89,257,503.36 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 59,759,612.01 | 55,724,290.49 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | -4,808,383.14 | -1,881,074.51 |
| 其中:股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -4,808,383.14 | -1,881,074.51 |
| 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(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 | 20,005,460.97 | 24,844,295.09 |
| 1. 管理人报酬 | 9,558,259.93 | 7,534,239.44 |
| 2. 托管费 | 3,186,086.60 | 2,511,413.12 |
| 3. 销售服务费 | 960,445.23 | 1,022,605.25 |
| 4. 交易费用 | 315.00 | 420.00 |
| 5. 利息支出 | 6,026,614.53 | 13,529,766.63 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 6,026,614.53 | 13,529,766.63 |
| 6. 税金及附加 | 89,397.56 | - |
| 7. 其他费用 | 184,342.12 | 245,850.65 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 181,244,534.31 | 223,141,954.18 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 181,244,534.31 | 223,141,954.18 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利京元宝货币市场基金

本报告期:2019年1月1日 至 2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019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) | 10,103,854,331.45 | - | 10,103,854,331.45 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 181,244,534.31 | 181,244,534.31 |
| 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) | 3,882,787,848.11 | - | 3,882,787,848.11 |
| 其中:1.基金申购款 | 11,011,259,879.15 | - | 11,011,259,879.15 |
| 2.基金赎回款 | -7,128,472,031.04 | - | -7,128,472,031.04 |
| 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) | - | -181,244,534.31 | -181,244,534.31 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 13,986,642,179.56 | - | 13,986,642,179.56 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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) | 12,912,770,733.28 | - | 12,912,770,733.28 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 223,141,954.18 | 223,141,954.18 |
| 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) | 925,738,635.56 | - | 925,738,635.56 |
| 其中:1.基金申购款 | 14,847,755,894.73 | - | 14,847,755,894.73 |
| 2.基金赎回款 | -13,922,017,259.17 | - | -13,922,017,259.17 |
| 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) | - | -223,141,954.18 | -223,141,954.18 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 13,838,509,368.84 | - | 13,838,509,368.84 |

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:

_____刘建_____ _____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

泰达宏利京元宝货币市场基金(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[2016]2141号《关于准予泰达宏利京元宝货币市场基金注册的批复》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《泰达宏利京元宝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200,652,912.54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(2016)第1505号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利京元宝货币市场基金基金合同》于2016年11月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,689,255.57份基金份额,其中认购资金利息折合36,343.03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,基金托管人为北京银行股份有限公司(以下简称"北京银行")。

根据《泰达宏利京元宝货币市场基金基金合同》和《泰达宏利京元宝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《泰达宏利京元宝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1年以内(含1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、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,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。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〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《泰达宏利京元宝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2019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2019年6月30日的财务状况以及2019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[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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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 |
| 北京银行股份有限公司("北京银行") | 基金托管人 |

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。

6.4.8 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

6.4.8.1.1 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方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.4 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方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 9,558,259.93 | 7,534,239.44 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 151,823.65 | 214,474.79 |

注:支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.15%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 X 0.15% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,186,086.60 | 2,511,413.12 |

注:支付基金托管人北京银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%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 0.05% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2019年1月1日至2019年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泰达宏利京元宝货币A | 泰达宏利京元宝货币B | 合计 |
| 泰达宏利基金管理有限公司 | 4,579.06 | 611,177.00 | 615,756.06 |
| 北京银行 | 4,020.93 | - | 4,020.93 |
| 合计 | 8,599.99 | 611,177.00 | 619,776.99 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泰达宏利京元宝货币A | 泰达宏利京元宝货币B | 合计 |
| 泰达宏利基金管理有限公司 | 5,333.90 | 455,604.17 | 460,938.07 |
| 北京银行 | 6,286.37 | - | 6,286.37 |
| 合计 | 11,620.27 | 455,604.17 | 467,224.44 |

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。

6.4.8.3 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

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 北京银行 | 99,344,605.13 | - | - | - | 7,996,200,000.00 | 654,706.73 |
| | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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 |
| 北京银行 | - | - | - | - | 7,820,100,000.00 | 728,587.58 |

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

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。

6.4.8.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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 |
| 北京银行 | 5,256,889.21 | 58,184.78 | 15,707,573.61 | 1,344,286.80 |

注:本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管,按约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年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可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2019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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为