# 泰达宏利聚利债券型证券投资基金
# （LOF）
# 2018 年半年度报告摘要

2018 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：2018 年 8 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 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 | 泰达宏利聚利债券（LOF） |
| 场内简称 | 泰达聚利 |
| 基金主代码 | 162215 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式（LOF） |
| 基金合同生效日 | 2016 年 5 月 14 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 | 118,156,893.64 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2016 年 5 月 25 日 |

注：上述基金合同生效日为基金转型起始日（2016 年 5 月 14 日）

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于固定收益证券，在合理控制信用风险的基础上，通过积极主动的管理，力求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 从利率、信用等角度深入挖掘信用债市场投资机会，在有效控制流动性风险及信用风险等风险的前提下，力争创造稳健收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债企业债总全价指数收益率×90%+中债国债全价指数收益率×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

## 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 | 袁静 | 王永民 |
| | 联系电话 | 010－66577513 | 010-66594896 |
| | 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 |

## 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 | http://www.mfcteda.com |

| | |
|---|---|
| 网址 | |
| 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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -6,525,091.38 |
| 本期利润 | -10,466,491.11 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0798 |
| 本期基金份额净值增长率 | -7.80% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（ 2018 年 6 月 30 日 ） |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2996 |
| 期末基金资产净值 | 113,069,223.76 |
| 期末基金份额净值 | 0.957 |

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

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．对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

## 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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | -1.03% | 0.36% | -0.14% | 0.03% | -0.89% | 0.33% |
| 过去三个月 | -3.24% | 0.46% | -0.27% | 0.07% | -2.97% | 0.39% |
| 过去六个月 | -7.80% | 0.59% | 0.24% | 0.06% | -8.04% | 0.53% |
| 过去一年 | -5.99% | 0.53% | -2.88% | 0.05% | -3.11% | 0.48% |
| 自基金合同生效起至今 | -4.30% | 0.37% | -13.25% | 0.09% | 8.95% | 0.28% |

注：本基金的业绩比较基准：中债企业债总全价指数收益率*90%+中债国债总全价指数收益率*10%

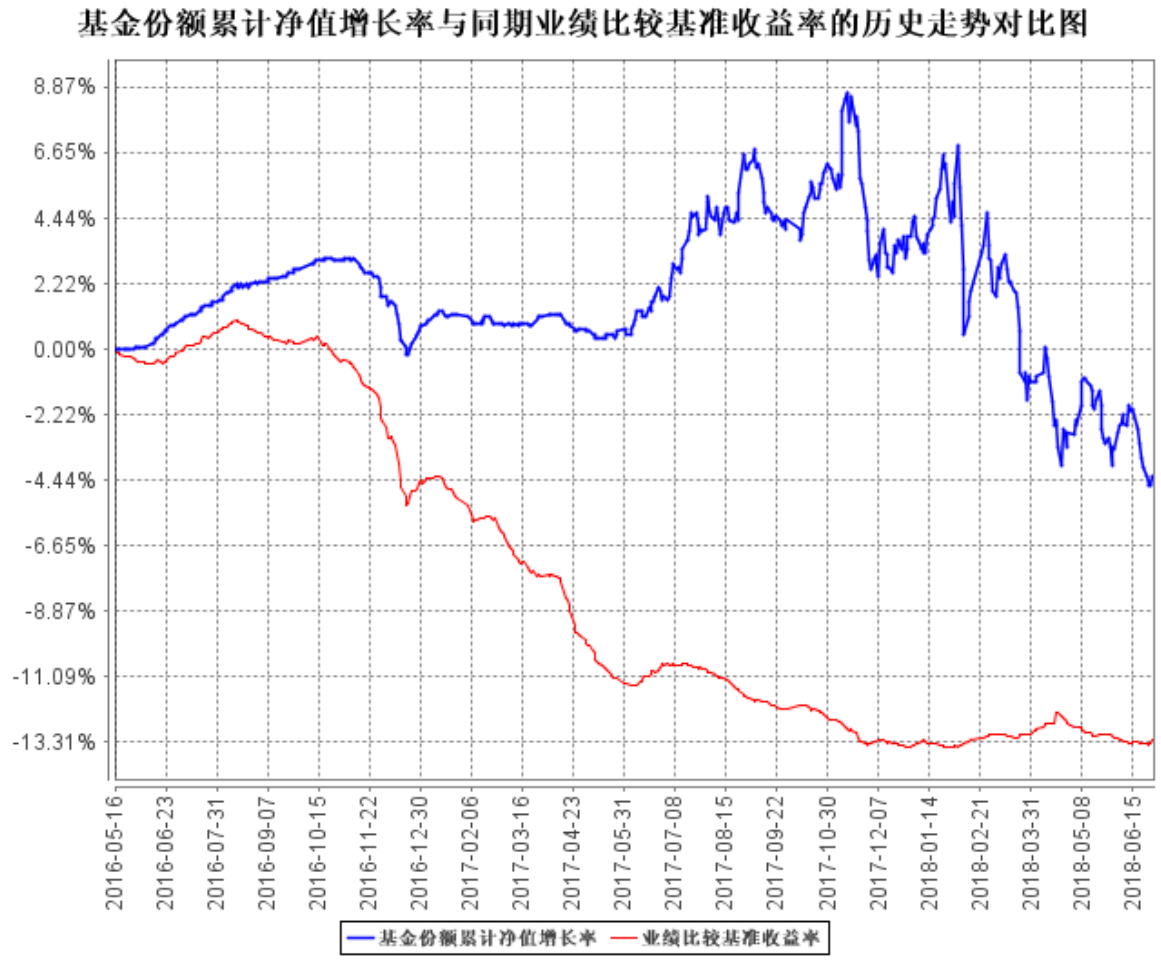
本基金集中投资于高收益信用债及国债，因此选取了中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数作为基准。上述两个指数分别反映我国企业债市场和国债市场整体价格和投资回报情况，

其样本与本基金的投资范围具有较高一致性，能够比较贴切的体现本基金的投资目标和风险收益特征。本基金根据在信用市场处于中性情况下的资产配置比例，赋予复合基准中两个指数以90%和 10%的权重，可以较为公允的衡量基金管理人的投资管理能力。

中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布。中央国债登记结算公司是财政部唯一授权主持建立、运营全国国债托管系统的机构，是中国人民银行指定的全国银行间债券市场债券登记、托管、结算机构和商业银行柜台记账式国债交易的一级托管人，作为指数发布主体具有绝对权威性。

中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数的构成品种完全覆盖了本基金的投资范围，反映债券全市场的整体价格和投资回报情况；同时，这两个指数在市场上具有较高的知名度，被广大投资者所认同，适合作为本基金的业绩比较基准。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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




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：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、泰达宏利信用合利定期开放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、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、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、泰达宏利京天宝货币市场基金、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 | | |
| 王靖 | 本基金基金经理；固定收益部副总经理 | 2017 年 10 月 16 日 | - | 11 | 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 11 年证券从业经验，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，央行两次降准为银行间市场带来稳定资金，流动性始终保持在宽松状态，各期限无风险利率逐步下行，收益率曲线呈平坦化。二季度中美贸易争端给国内经济带来较大不确定性，叠加社融和 M2 数据的显著下行，市场对于经济增长的预期较悲观。同时，报告期内信用风险事件频发，在预计经济下行期间，投资者大幅降低风险偏好，中低等级信用债流动性几近枯竭。

本基金在报告期内保持较高的可转债仓位，受股市下行影响，基金净值表现不佳。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.957 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.80%，业绩比较基准收益率为 0.24%。

## 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，流动性有望继续保持宽松状态，在宽货币稳信用的指导思想下，预期央行还有 1-2 次全面降准，短端利率维持低位。中长端利率主要受到信用扩张的影响，若财政发力，经济下行预期或需要阶段性修正，利好高等级信用债，利空长久期利率债。若经济企稳，权益市场的机会相对更值得关注。

本基金未进行信用债投资，未来将保持利率债高仓位和低仓位的可转债博取弹性。

### 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

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

### 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”）在泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）（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、基金份额申购赎回价格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”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。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”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：泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）
报告截止日： 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| **资 产：** | | |
| 银行存款 | 4,163,412.71 | 7,957,772.08 |
| 结算备付金 | 150,507.57 | 130,092.74 |
| 存出保证金 | 9,671.21 | 5,560.88 |
| 交易性金融资产 | 103,082,160.00 | 173,218,734.49 |
| 其中：股票投资 | 6,432,000.00 | 31,362,369.89 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 96,650,160.00 | 141,856,364.60 |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 | 4,326,019.22 | 7,229,781.18 |
| 应收利息 | 1,622,024.40 | 4,391,595.63 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 113,353,795.11 | 192,933,537.00 |
| **负债和所有者权益** | **本期末<br>2018 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>2017 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 | - | 35,149,827.27 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | 971.43 | 12,657,326.85 |
| 应付管理人报酬 | 67,740.44 | 92,745.37 |
| 应付托管费 | 19,354.39 | 26,498.69 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 13,288.87 | 8,557.31 |
| 应交税费 | 71,641.66 | 71,057.38 |
| 应付利息 | - | 23,241.87 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 111,574.56 | 459,502.51 |
| 负债合计 | 284,571.35 | 48,488,757.25 |
| **所有者权益：** | | |
| 实收基金 | 77,667,667.35 | 91,431,342.29 |
| 未分配利润 | 35,401,556.41 | 53,013,437.46 |
| 所有者权益合计 | 113,069,223.76 | 144,444,779.75 |
| 负债和所有者权益总计 | 113,353,795.11 | 192,933,537.00 |

注：报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.957 元，基金份额总额 118,156,893.64 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）
本报告期： 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年<br>6 月 30 日 |
|---|---|---|
| **一、收入** | -9,583,774.87 | 6,694,165.74 |
| 1.利息收入 | 1,624,708.77 | 11,399,105.32 |
| 其中：存款利息收入 | 6,969.03 | 33,236.95 |
| 债券利息收入 | 1,617,739.74 | 11,174,180.17 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | 191,688.20 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -7,271,331.66 | -14,984,623.10 |
| 其中：股票投资收益 | -3,709,841.89 | -3,730,667.13 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -3,586,692.74 | -11,367,355.97 |
| 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 | 25,202.97 | 113,400.00 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -3,941,399.73 | 10,192,401.84 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 4,247.75 | 87,281.68 |
| **减：二、费用** | 882,716.24 | 3,088,805.20 |
| 1．管理人报酬 | 458,188.22 | 1,450,929.03 |
| 2．托管费 | 130,910.93 | 414,551.14 |
| 3．销售服务费 | - | - |
| 4．交易费用 | 34,878.58 | 29,369.43 |
| 5．利息支出 | 125,023.79 | 934,311.83 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 125,023.79 | 934,311.83 |
| 6．税金及附加 | 604.47 | - |
| 7．其他费用 | 133,110.25 | 259,643.77 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | -10,466,491.11 | 3,605,360.54 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | -10,466,491.11 | 3,605,360.54 |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）
本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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） | 91,431,342.29 | 53,013,437.46 | 144,444,779.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | -10,466,491.11 | -10,466,491.11 |
| 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） | -13,763,674.94 | -7,145,389.94 | -20,909,064.88 |
| 其中：1.基金申购款 | 330,495.69 | 190,393.96 | 520,889.65 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 2.基金赎回款 | -14,094,170.63 | -7,335,783.90 | -21,429,954.53 |
| 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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 77,667,667.35 | 35,401,556.41 | 113,069,223.76 |
| **项目** | **上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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） | 418,377,658.84 | 222,987,761.11 | 641,365,419.95 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 3,605,360.54 | 3,605,360.54 |
| 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） | -228,024,391.86 | -122,146,826.06 | -350,171,217.92 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,163,962.83 | 1,169,201.13 | 3,333,163.96 |
| 2.基金赎回款 | -230,188,354.69 | -123,316,027.19 | -353,504,381.88 |
| 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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 190,353,266.98 | 104,446,295.59 | 294,799,562.57 |

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

泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)由泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金(以下简称“泰达宏利聚利分级债券基金”)转型而来。根据《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，基金合同生效满五年后，满足基金合同约定的存续条件，泰达宏利聚利分级债券基金无需召开基金份额持有人大会，将自动转换为上市开放式基金(LOF)，基金份额仍将在

深圳证券交易所上市交易。原泰达宏利聚利分级债券基金更名为泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。泰达宏利聚利分级债券基金于转换前的基金资产净值为 2,406,935,014.91 元，已于 2016 年 5 月 13 日全部转为本基金的基金资产净值，按照本基金的基金份额净值 1.000 元折合为 2,406,935,014.91 份泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金份额，并由本基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。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《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》、《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》和《泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)上市交易公告书》，泰达宏利聚利分级债券基金将基金份额持有人初始有效认购的基金总份额按照 7：3 的比例分离为预期收益与预期风险不同的两种份额类别，即优先类基金份额(基金份额简称“聚利 A”)和进取类基金份额(基金份额简称“聚利 B”)。于转换日(即 2016 年 5 月 13 日)，泰达宏利聚利分级债券基金的基金资产净值为 2,406,935,014.91 元，按照本基金的基金份额净值 1.000 元转换为 2,406,935,014.91 份泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金份额(其中，聚利 A 的基金资产净值为 1,355,349,958.68 元，转换为 1,355,349,958.68 份本基金份额；聚利 B 的基金资产净值为 1,051,585,056.23 元，转换为 1,051,585,056.23 份本基金份额)。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2016]第 317 号文审核同意，本基金场内交易总份额为 2,074,449,884.00 份，于 2016 年 5 月 25 日在深交所挂牌交易(交易代码：162215)。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，转换后，本基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变。本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金在封闭期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%。在开放期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的

5%。本基金的业绩比较基准为：中债企业债总全价指数收益率 × 90% + 中债国债总全价指数收益率 × 10%。

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 2018 年 8 月 27 日批准报出。

### 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》、《泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）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 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股

息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票、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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)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、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。

### 6.4.8 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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 458,188.22 | 1,450,929.03 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 44,970.70 | 68,868.87 |

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 0.70%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 0.70% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 130,910.93 | 414,551.14 |

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 0.20%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×0.20% / 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

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。

### 6.4.8.4 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内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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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 | 4,163,412.71 | 6,370.88 | 2,926,149.48 | 25,601.60 |

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。

### 6.4.8.6 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（ 2018 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抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

##### 6.4.9.3.2 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。

### 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。

## §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 | 权益投资 | 6,432,000.00 | 5.67 |
| | 其中：股票 | 6,432,000.00 | 5.67 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 96,650,160.00 | 85.26 |
| | 其中：债券 | 96,650,160.00 | 85.26 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,313,920.28 | 3.81 |
| 8 | 其他各项资产 | 5,957,714.83 | 5.26 |
| 9 | 合计 | 113,353,795.11 | 100.00 |

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 6,432,000.00 | 5.69 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 6,432,000.00 | 5.69 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值 |
|---|---|---|---|---|---|

| | | | | | 比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601336 | 新华保险 | 150,000 | 6,432,000.00 | 5.69 |

注：上述股票明细为本基金本报告期末持有的全部股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601138 | 工业富联 | 13,770.00 | 0.01 |
| 2 | 601828 | 美凯龙 | 10,230.00 | 0.01 |

注:“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600004 | 白云机场 | 5,519,481.81 | 3.82 |
| 2 | 002241 | 歌尔股份 | 4,663,706.78 | 3.23 |
| 3 | 601238 | 广汽集团 | 3,749,808.68 | 2.60 |
| 4 | 601336 | 新华保险 | 2,423,126.65 | 1.68 |
| 5 | 601138 | 工业富联 | 24,940.00 | 0.02 |
| 6 | 601828 | 美凯龙 | 22,840.00 | 0.02 |

注:“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 24,000.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 16,403,903.92 |

“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 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 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 12,438,860.00 | 11.00 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 68,425,600.00 | 60.52 |
| | 其中：政策性金融债 | 68,425,600.00 | 60.52 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 15,785,700.00 | 13.96 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 96,650,160.00 | 85.48 |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 140202 | 14 国开 02 | 400,000 | 40,436,000.00 | 35.76 |
| 2 | 018006 | 国开 1702 | 160,000 | 15,944,000.00 | 14.10 |
| 3 | 010107 | 21 国债⑺ | 120,000 | 12,264,000.00 | 10.85 |
| 4 | 018005 | 国开 1701 | 120,000 | 12,045,600.00 | 10.65 |
| 5 | 132005 | 15 国资 EB | 80,000 | 8,775,200.00 | 7.76 |

## 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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

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。

### 7.11.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.11.3 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 | 9,671.21 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,326,019.22 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,622,024.40 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,957,714.83 |

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 132005 | 15 国资 EB | 8,775,200.00 | 7.76 |

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

# §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

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 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 |
| 1,500 | 78,771.26 | 90,059,327.85 | 76.22% | 28,097,565.79 | 23.78% |

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 工银瑞信基金－工商银行－特定客户资产管理 | 31,705,316.00 | 30.84% |
| 2 | 中银保险有限公司－传统保险产品 | 20,623,367.00 | 20.06% |
| 3 | 中国出口信用保险公司 | 13,832,950.00 | 13.46% |
| 4 | 工银瑞信基金公司－建行－中国建设银行股份有限公司 | 5,379,387.00 | 5.23% |
| 5 | 工银瑞信基金公司－农行－中国农业银行离退休人员福利负债 | 4,556,580.00 | 4.43% |
| 6 | 中国石油天然气集团公司企业年金计划－中国工商银行股份有限公 | 4,000,000.00 | 3.89% |
| 7 | 张跃霞 | 3,766,490.00 | 3.66% |
| 8 | 中国中煤能源集团有限公司企业年金计划－中国银行股份有限公司 | 2,369,509.00 | 2.31% |
| 9 | 云南省烟草公司楚雄州公司企业年金计划－中信银行股份有限公司 | 1,777,118.00 | 1.73% |
| 10 | 赵瑞珍 | 1,212,253.00 | 1.18% |

注：持有人为本基金场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 0.00 | 0.0000% |

### 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的情况

| 项目 | 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（ 2016 年 5 月 14 日 ）基金份额总额 | 2,406,935,014.91 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 139,092,588.52 |
| 本报告期基金总申购份额 | 502,753.04 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 21,438,447.92 |
| 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 | 118,156,893.64 |

## §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 2018 年 4 月 28 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》，张萍女士因个人健康原因辞去公司督察长职务，由公司总经理刘建先生于 4 月 28 日起代为履行公司督察长职务。

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

本报告期内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

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 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 | |
| 中银国际 | 1 | 11,740,197.14 | 71.57% | 10,933.38 | 71.57% | - |
| 湘财证券 | 1 | 4,663,706.78 | 28.43% | 4,343.29 | 28.43% | - |

注：(一)2018 年上半年本基金新增长江证券交易单元。

（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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 中银国际 | 97,594,309.80 | 80.97% | 34,200,000.00 | 100.00% | - | - |
| 湘财证券 | 22,936,314.64 | 19.03% | - | - | - | - |

# §11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20180101-20180630 | 31,705,316.00 | 0.00 | 0.00 | 31,705,316.00 | 26.83% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。 | | | | | | | |

报告期内，申购份额含红利再投资份额。

## 11.2影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）以及相关基金合同和托管协议的有关规定，经与各基金托管人协商一致，并履行了必要程序，本基金管理人对本基金基金合同和托管协议进行修改。另外，根据《流动性风险规定》相关规定，自 2018 年 3 月 31 日起，本管理人对持续持有期少于 7 日的除货币市场基金外的基金赎回申请，收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。转换业务涉及的转出基金赎回费率等事项按上述规则进行调整。详情请见基金管理人 2018 年 3 月 24 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下 51 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》以及更新后的基金合同与托管协议。

泰达宏利基金管理有限公司
2018 年 8 月 27 日