

泰达宏利亚洲债券型证券投资基金 2019 年 半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 24 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 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
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遵规守信情况的说明.....	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
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
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
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	37
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	38

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	38
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	38
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	39
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	39
7.11 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息.....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.3 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
§9 开放式基金份额变动.....	40
§10 重大事件揭示.....	41
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	42
§11 备查文件目录.....	44
11.1 备查文件目录.....	44
11.2 存放地点.....	44
11.3 查阅方式.....	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利亚洲债券型证券投资基金	
基金简称	泰达宏利亚洲债券（QDII）	
基金主代码	003463	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 10 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	80,819,070.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利亚洲债券（QDII）A	泰达宏利亚洲债券（QDII）C
下属分级基金的交易代码	003463	003464
报告期末下属分级基金的份额总额	69,859,097.64 份	10,959,972.98 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，在谨慎投资的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金为债券型的 QDII 基金，密切跟踪相关国家或地区经济的景气周期以及财政、货币政策变化，把握市场利率水平的运行态势，从宏观层面了解亚洲各国家、行业的景气情况、防范系统性的宏观经济、政治以及信用风险，从而确定基金资产在不同国家、不同行业以及不同债券品种之间的配置比例。
业绩比较基准	摩根大通亚洲信用指数总报酬 (JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return) ×95%+中国人民银行公告人民币活期存款基准利率×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险水平和预期收益都要低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。

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 姓名	聂志刚	王永民

负责人	联系电话	010-66577678	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
注册地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		弓劲梅	刘连舸

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	中文	-	中国银行（香港）有限公司
	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
注册地址		-	香港花园道1号中银大厦
办公地址		-	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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

2.6 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	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

§ 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(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	泰达宏利亚洲债券（QDII）A	泰达宏利亚洲债券（QDII）C
本期已实现收益	2,180,612.48	142,004.19

本期利润	6,575,487.73	461,633.71
加权平均基金份额本期利润	0.0870	0.0805
本期加权平均净值利润率	8.82%	8.15%
本期基金份额净值增长率	9.43%	9.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	-5,746,772.39	-1,013,388.74
期末可供分配基金份额利润	-0.0823	-0.0925
期末基金资产净值	72,732,257.47	11,285,970.44
期末基金份额净值	1.0411	1.0297
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.11%	2.97%

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. 期末可供分配利润等于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

泰达宏利亚洲债券（QDII）A

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	0.83%	0.14%	1.51%	0.14%	-0.68%	0.00%
过去三个月	4.98%	0.19%	2.86%	0.11%	2.12%	0.08%
过去六个月	9.43%	0.23%	7.63%	0.11%	1.80%	0.12%
过去一年	8.99%	0.28%	9.51%	0.11%	-0.52%	0.17%
自基金合同生	4.11%	0.25%	10.16%	0.13%	-6.05%	0.12%

泰达宏利亚洲债券（QDII）C

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	0.80%	0.14%	1.51%	0.14%	-0.71%	0.00%
过去三个月	4.90%	0.19%	2.86%	0.11%	2.04%	0.08%
过去六个月	9.23%	0.23%	7.63%	0.11%	1.60%	0.12%
过去一年	8.58%	0.28%	9.51%	0.11%	-0.93%	0.17%
自基金合同生	2.97%	0.25%	10.16%	0.13%	-7.19%	0.12%

注：本基金业绩比较基准：摩根大通亚洲信用指数总报酬

(JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return)*95%+中国人民银行公告人民币活期存款基准利率*5%。

上述摩根大通亚洲信用指数总报酬代表该指数收益率。

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

泰达宏利亚洲债券（QDII）A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰达宏利亚洲债券（QDII）C 累计净值增长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		
李安杰	本基金基金经理	2016 年 10 月 14 日	-	11	台湾成功大学财务金融硕士；CFA；2008 年 7 月至 2014 年 4 月，就职于国泰人寿保险股份有限公司，负责海外债券投资；2014 年 5 月至 2016 年 1 月，就职于国泰证券投资信托股份有限公司，担任台湾地区国泰投信-新兴市场高收益债基金经理；2016 年 2 月加盟泰达宏利基金管理有限公司国际

					业务部，现任基金经理；具有 11 年证券投资管理经验，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

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，未发现明显的非公平交易指令；基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

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。

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

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

2019 年上半年，美国经济动能减缓，中美贸易疑虑再起，市场对美国降息预期大增，美联储亦明显转向鸽派，带动美债利率大幅下行。国内信用事件虽仍时有所闻，突如其来的包商银行事件更是所料未及，但国内经济在政策支持发力下，呈现改善态势，金融市场亦在央行开始强化市场流动性后，坐实了市场对国内宽松基调的信心。债市发行人的国内融资渠道逐渐畅通改善，连带提振了整体亚债市场情绪，使上半年信用利差出现大幅度收窄。投资组合调整上，我们保持了一贯的分散性，并于信用利差收窄时增持了高收益债部位，同时扩大了久期以配合大幅下滑的基准利率。随后伴随整体市场估值上扬，投资组合再次调回较为中性的水准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利亚洲债券（QDII）A 基金份额净值为 1.0411 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.43%；截至本报告期末泰达宏利亚洲债券（QDII）C 基金份额净值为 1.0297 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.23%；同期业绩比较基准收益率为 7.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年下半年预期全球经济仍将面临压力，而各国央行也将再次展开宽松政策，有助维持市场流动性，降低债券发行人再融资难度，同时将基准利率维持在较低水准。信用选择上，国内部分信用资质较差的发行人恐难受益于市场流动性改善，因为其信用风险较高，再融资不易，预期下半年违约状况改善不易。另外中美纷争亦有波及危害其它亚洲发行人信用水平的可能性。因此在目前评价面相对较高情况下，信用债的选择预期投资等级表现较佳。

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

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金本报告期内未进行利润分配。目前无其他利润分配安排。

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”）在泰达宏利亚洲债券型证券投资基金（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。

§ 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：泰达宏利亚洲债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	10,964,160.06	11,679,418.11
结算备付金		768,902.13	760,401.24
存出保证金		-	3,225.76
交易性金融资产	6.4.7.2	77,751,856.78	72,293,153.48
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		77,751,856.78	72,293,153.48
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,111,981.19	1,178,044.78
应收股利		-	-
应收申购款		307,751.64	508.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		90,904,651.80	85,914,751.96
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,174,871.53	-
应付赎回款		2,533,087.90	226,042.50
应付管理人报酬		67,658.22	69,658.64
应付托管费		16,914.55	17,414.64
应付销售服务费		3,423.01	1,552.63
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		10,474.72	10,581.65
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,993.96	247,018.84
负债合计		6,886,423.89	572,268.90
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	80,819,070.62	89,742,113.32
未分配利润	6.4.7.10	3,199,157.29	-4,399,630.26
所有者权益合计		84,018,227.91	85,342,483.06
负债和所有者权益总计		90,904,651.80	85,914,751.96

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额总额80,819,070.62份，其中泰达宏利亚洲债券(QDII) A 基金份额总额为69,859,097.64份，基金份额净值1.0411元；泰达宏利亚洲债券（QDII）C 基金份额总额为10,959,972.98份，基金份额净值1.0297元。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利亚洲债券型证券投资基金

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	附注号	本期	上年度可比期间
		2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		7,627,103.42	-13,113,892.41
1. 利息收入		1,998,312.02	4,497,760.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,667.10	84,020.82
债券利息收入		1,977,644.92	4,413,739.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		781,057.11	-20,034,074.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	781,057.11	-18,024,416.49
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-2,009,658.17
股利收益	6.4.7.17	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,714,504.77	3,222,078.71

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		122,916.17	-933,453.94
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	10,313.35	133,796.83
减：二、费用		589,981.98	1,446,964.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	397,147.32	1,026,323.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	99,286.82	256,580.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	11,065.49	10,182.13
4. 交易费用	6.4.7.20	-	5,209.92
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		7,119.54	23,622.77
7. 其他费用	6.4.7.21	75,362.81	125,045.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,037,121.44	-14,560,856.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,037,121.44	-14,560,856.85

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利亚洲债券型证券投资基金

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）	89,742,113.32	-4,399,630.26	85,342,483.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	7,037,121.44	7,037,121.44
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）	-8,923,042.70	561,666.11	-8,361,376.59
其中：1. 基金申购款	16,691,822.12	370,345.63	17,062,167.75
2. 基金赎回款	-25,614,864.82	191,320.48	-25,423,544.34
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）	80,819,070.62	3,199,157.29	84,018,227.91
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）	313,043,061.59	2,210,267.77	315,253,329.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-14,560,856.85	-14,560,856.85
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）	-221,791,261.33	8,226,864.30	-213,564,397.03
其中：1. 基金申购款	292,864.34	-11,523.95	281,340.39
2. 基金赎回款	-222,084,125.67	8,238,388.25	-213,845,737.42
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）	91,251,800.26	-4,123,724.78	87,128,075.48

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

泰达宏利亚洲债券型证券投资基金(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]2074 号《关于准予泰达宏利亚洲债券型证券投资基金注册的批复》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《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金基金合同》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 698,402,253.26 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 1258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 10 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 698,402,253.26 份基金份额,募集期间有效认购款项未产生利息。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”),境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司(以下简称“中国银行(香港)”)。

根据《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据基金认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类

别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不主动参与股票等权益类资产的投资。本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于亚洲债券的比例不低于非现金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为摩根大通亚洲信用指数总报酬(JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return)X95%+中国人民银行公告人民币活期存款基准利率 X5%。

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》、《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金基金合同》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。

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

本基金本报告期末发生会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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。

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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(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 2019年6月30日
活期存款	10,964,160.06
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	10,964,160.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	-	-	
	OTC市场	74,168,126.59	77,751,856.78	3,583,730.19
	合计	74,168,126.59	77,751,856.78	3,583,730.19
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	74,168,126.59	77,751,856.78	3,583,730.19	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,361.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	1,110,619.47
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,111,981.19

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,068.27
预提费用	71,925.69
合计	79,993.96

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰达宏利亚洲债券（QDII）A

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	84,887,365.89	84,887,365.89

本期申购	8,349,081.98	8,349,081.98
本期赎回（以“-”号填列）	-23,377,350.23	-23,377,350.23
-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	69,859,097.64	69,859,097.64

泰达宏利亚洲债券（QDII）C

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,854,747.43	4,854,747.43
本期申购	8,342,740.14	8,342,740.14
本期赎回（以“-”号填列）	-2,237,514.59	-2,237,514.59
-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	10,959,972.98	10,959,972.98

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

泰达宏利亚洲债券（QDII）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,498,594.34	5,377,006.63	-4,121,587.71
本期利润	2,180,612.48	4,394,875.25	6,575,487.73
本期基金份额 交易产生的变 动数	1,571,209.47	-1,151,949.66	419,259.81
其中：基金申 购款	-715,854.79	951,337.80	235,483.01
基金赎 回款	2,287,064.26	-2,103,287.46	183,776.80
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	-5,746,772.39	8,619,932.22	2,873,159.83
泰达宏利亚洲债券（QDII）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-582,805.79	304,763.24	-278,042.55
本期利润	142,004.19	319,629.52	461,633.71
本期基金份额 交易产生的变 动数	-572,587.14	714,993.44	142,406.30

其中：基金申购款	-803,504.39	938,367.01	134,862.62
基金赎回款	230,917.25	-223,373.57	7,543.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,013,388.74	1,339,386.20	325,997.46

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
活期存款利息收入		13,024.03
定期存款利息收入		516.46
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		7,115.51
其他		11.10
合计		20,667.10

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内未有股票投资差价收入。

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内未有基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入		781,057.11
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		781,057.11

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	53,596,071.29
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	52,156,371.65
减：应收利息总额	658,642.53
买卖债券差价收入	781,057.11

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内未有债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内未有债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未有资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内未有贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内未有贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内未有贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内未有贵金属投资收益—申购差价收入。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内未有衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期内未有股利收益。

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	4,714,504.77
股票投资	-
债券投资	4,714,504.77
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,714,504.77

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	5,569.80
其他	4,743.55
合计	10,313.35

6.4.7.20 交易费用

本基金本报告期内未有交易费用。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	33,224.36
信息披露费	38,701.33
银行费用	1,160.04
境外 OOP 费用	2,277.08
合计	75,362.81

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期无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
中国银行（香港）有限公司（“中国银行（香港）”）	基金境外托管人

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

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交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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	
	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 成交总额的比例 (%)
中国银行(香港)	-	-	8,308,905.91	2.24

注：本基金本报告期未通过关联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交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 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 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	397,147.32	1,026,323.60
其中：支付销售机构的客户维护费	178,161.06	244,069.86

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的 1.0%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 $\times 1.0\%$ / 当年天数；

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	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	99,286.82	256,580.91

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 0.25% 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 $\times 0.25\%$ / 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		
	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		
	泰达宏利亚洲债券 (QDII) A	泰达宏利亚洲债券 (QDII) C	合计
中国银行	-	220.07	220.07
泰达宏利基金管理有限公司	-	119.71	119.71
合计	-	339.78	339.78
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		
	泰达宏利亚洲债券 (QDII) A	泰达宏利亚洲债券 (QDII) C	合计
中国银行	-	462.95	462.95
泰达宏利基金管理有限公司	-	21.49	21.49
合计	-	484.44	484.44

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.4% 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 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 $\times 0.4\%$ / 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度可比期间均未与关联方进行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。

6.4.10.4.2 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 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
中国银行(香港)	4,937,086.97	516.46	7,609,409.72	5,569.99
中国银行	6,027,073.09	13,024.03	5,385,686.51	38,585.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行和境外托管人中国银行(香港)保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 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均未发生其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末(2019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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

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

本基金为债券型基金，其预期的风险水平和预期收益都要低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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，通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，在谨慎投资的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。

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管理委员会，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。本基金的银行存款存放在本基金的基金托管人中国银行和境外托管人中国银行(香港)，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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债券投资。

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

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同业存单。

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	73,554,536.19	63,636,166.93
未评级	4,197,320.59	8,656,986.55
合计	77,751,856.78	72,293,153.48

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，未提供评级信息的可适用内部评级。

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。

于 2019 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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。

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公司的证券不得超过该证券的 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 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本基金所持大部分证券在证券交易所挂牌并进行柜台买卖，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理市价适时变现。此外，本基金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，并采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%，且所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值不得超过基金总资产的 50%。

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。

本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于在证券交易所进行柜台买卖的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,964,160.06	-	-	-	10,964,160.06
结算备付金	768,902.13	-	-	-	768,902.13
交易性金融资产	1,385,540.79	27,858,291.83	48,508,024.16	-	77,751,856.78
应收利息	-	-	-	1,111,981.19	1,111,981.19
应收申购款	-	-	-	307,751.64	307,751.64
资产总计	13,118,602.98	27,858,291.83	48,508,024.16	1,419,732.83	90,904,651.80
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,174,871.53	4,174,871.53
应付赎回款	-	-	-	2,533,087.90	2,533,087.90
应付管理人报酬	-	-	-	67,658.22	67,658.22
应付托管费	-	-	-	16,914.55	16,914.55
应付销售服务费	-	-	-	3,423.01	3,423.01
应付税费	-	-	-	10,474.72	10,474.72
其他负债	-	-	-	79,993.96	79,993.96
负债总计	-	-	-	6,886,423.89	6,886,423.89
利率敏感度缺口	13,118,602.98	27,858,291.83	48,508,024.16	-5,466,691.06	84,018,227.91
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	11,679,418.11	-	-	-	11,679,418.11
结算备付金	760,401.24	-	-	-	760,401.24
存出保证金	3,225.76	-	-	-	3,225.76
交易性金融资产	-30,003,316.13	42,289,837.35	-	-	72,293,153.48
应收利息	-	-	-	1,178,044.78	1,178,044.78
应收申购款	-	-	-	508.59	508.59
资产总计	12,443,045.11	30,003,316.13	42,289,837.35	1,178,553.37	85,914,751.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	226,042.50	226,042.50
应付管理人报酬	-	-	-	69,658.64	69,658.64
应付托管费	-	-	-	17,414.64	17,414.64
应付销售服务费	-	-	-	1,552.63	1,552.63
应付税费	-	-	-	10,581.65	10,581.65
其他负债	-	-	-	247,018.84	247,018.84
负债总计	-	-	-	572,268.90	572,268.90
利率敏感度缺口	12,443,045.11	30,003,316.13	42,289,837.35	606,284.47	85,342,483.06

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）	
分析	市场利率下降25个基点	840,000.00	880,000.00
	市场利率上升25个基点	-840,000.00	-880,000.00

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	4,937,033.98	-	-	4,937,033.98
结算备付金	768,902.13	-	-	768,902.13
交易性金融资产	77,751,856.78	-	-	77,751,856.78
应收利息	1,110,619.47	-	-	1,110,619.47
资产合计	84,568,412.36	-	-	84,568,412.36
以外币计价的负债				
应付证券清算款	4,174,871.53	-	-	4,174,871.53
负债合计	4,174,871.53	-	-	4,174,871.53
资产负债表外汇风险敞口净额	80,393,540.83	-	-	80,393,540.83
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	2,312,857.08	-	-	2,312,857.08
结算备付金	760,401.24	-	-	760,401.24
交易性金融资产	72,293,153.48	-	-	72,293,153.48
应收利息	1,174,196.77	-	-	1,174,196.77
资产合计	76,540,608.57	-	-	76,540,608.57
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	76,540,608.57	-	-	76,540,608.57

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月	

			31 日)
分析	所有外币相对人民币升值 5%	4,020,000.00	3,830,000.00
	所有外币相对人民币贬值 5%	-4,020,000.00	-3,830,000.00

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。本基金主要投资于政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券，已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金等，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于亚洲债券的比例不低于非现金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	77,751,856.78	85.53
	其中：债券	77,751,856.78	85.53
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,733,062.19	12.91
8	其他各项资产	1,419,732.83	1.56
9	合计	90,904,651.80	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
AAA	0.00	0.00
AA+至 AA-	1,565,162.95	1.86
A+至 A-	11,616,060.29	13.83
BBB+至 BBB-	30,553,428.60	36.37
BB+至 BB-	17,339,602.09	20.64
B+至 B-	12,480,282.26	14.85
CCC+至 C	-	-
其它	4,197,320.59	5.00
总计	77,751,856.78	92.54

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，未提供评级信息的可适用内部评级。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	USG9600GAA07	WTT Investment Ltd/Hong Kong	2,062,410	2,132,119.46	2.54
2	XS1366918305	OVPH Ltd	2,062,410	2,101,616.41	2.50
3	USY59501AA78	Medco Oak Tree Pte Ltd	2,062,410	2,070,515.27	2.46
4	US948596AD39	Weibo Corp	2,062,410	2,069,380.95	2.46
5	USY9896RAB79	Zoomlion HK SPV Co Ltd	2,062,410	2,065,214.88	2.46

注：1. 债券代码为 ISIN 码。

2. 数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

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

本基金本报告期内未投资任何股票。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,111,981.19
5	应收申购款	307,751.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,419,732.83

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

份额级别	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（%）
泰达宏利亚洲债券（QDII）A	687	101,687.19	18,016,668.42	25.79	51,842,429.22	74.21
泰达宏利亚洲债券（QDII）C	433	25,311.72	980.78	0.01	10,958,992.20	99.99
合计	1,120	72,159.88	18,017,649.20	22.29	62,801,421.42	77.71

8.2 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	泰达宏利亚洲债券（QDII）A	0.00	0.0000
	泰达宏利亚洲债券（QDII）C	5.83	0.0001
	合计	5.83	0.0000

8.3 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	泰达宏利亚洲债券（QDII）A	0
	泰达宏利亚洲债券（QDII）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利亚洲债券（QDII）A	0
	泰达宏利亚洲债券（QDII）C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利亚洲债券（QDII）A	泰达宏利亚洲债券（QDII）C
基金合同生效日（2016年10月14日）基金份额总额	677,180,230.83	21,222,022.43
本报告期期初基金份额总额	84,887,365.89	4,854,747.43
本报告期基金总申购份额	8,349,081.98	8,342,740.14

减：本报告期基金总赎回份额	23,377,350.23	2,237,514.59
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	69,859,097.64	10,959,972.98

§ 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基金份额持有人大会。

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 2019 年 1 月 19 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》，王彦杰先生不再担任公司副总经理。

2、2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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. 本报告期内，中国证券监督管理委员会北京监管局对我司进行了常规全面现场检查，就公司未能建立完善的内控监控体系，提出了整改意见并下达了行政监管措施函，公司对此高度重视，立即制定整改计划和整改方案，认真进行整改，排除业务中存在的风险隐患，逐一落实各项整改要求，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力。公司已按照要求于 2019 年 4 月完成整改工作，并通过了中国证券监督管理委员会北京监管局的检查验收。

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	
Barclays Bank PLC	1	-	-	-	-	-
BNP PARIBSA	1	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation	1	-	-	-	-	-
CITIC Securities International	1	-	-	-	-	-
DBS BANK LIMITED HONG KONG BRANCH	1	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	1	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities(HONG	1	-	-	-	-	-
Haitong Securities Company Limited	1	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Limited	1	-	-	-	-	-
Societe Generale	1	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	1	-	-	-	-	-
UBS AG	1	-	-	-	-	-
Wells Fargo	1	-	-	-	-	-
Bank of China(Hong Kong) Ltd.	1	-	-	-	-	-
Bank of America Merrill Lynch	1	-	-	-	-	-
Nomura International plc	1	-	-	-	-	-
Credit Suisse	1	-	-	-	-	-

注：1. 本基金本报告期新增 Haitong Securities Company Limited 交易单元；

2. 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，使用其席位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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Barclays Bank PLC	2,686,119.14	2.66%	-	-	-	-	-	-
BNP PARIBSA	13,207,089.38	13.09%	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation	1,365,001.78	1.35%	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities International	9,605,267.12	9.52%	-	-	-	-	-	-
DBS BANK LIMITED HONG KONG BRANCH	6,827,356.14	6.77%	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	8,655,862.95	8.58%	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities(HONG	1,353,500.00	1.34%	-	-	-	-	-	-
Haitong Securities Company Limited	4,406,004.01	4.37%	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Limited	7,227,596.21	7.17%	-	-	-	-	-	-
Societe Generale	2,070,113.94	2.05%	-	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	12,715,467.13	12.61%	-	-	-	-	-	-

UBS AG	14,368,094.76	14.24%	-	-	-	-	-	-
Wells Fargo	16,385,735.19	16.24%	-	-	-	-	-	-
Bank of China (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Bank of America Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International plc	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 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

基金管理人和基金托管人的住所

11.3 查阅方式

基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《上海证券报》）或登录本基金管理人互联网网址（<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（免长话费）或 010-66555662，网址：<http://www.mfcteda.com>。

泰达宏利基金管理有限公司

2019年8月24日