

# 泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券 投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期间为 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日。

## § 2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利乐盈 66 个月定开债	
基金主代码	009814	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 7 月 31 日	
报告期末基金份额总额	7,800,187,467.02 份	
投资目标	本基金严格采用持有到期策略，将基金资产配置于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的固定收益资产，力求实现基金资产的持续稳定增值。	
投资策略	本基金将在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。在每一封闭期内将根据基金合同的规定，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。一般情况下，本基金将在封闭期内持有这些品种到期。	
业绩比较基准	在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的三年期银行定期存款利率（税后）+1.25%。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利乐盈 66 个月定开债 A	泰达宏利乐盈 66 个月定开债 C
下属分级基金的交易代码	009814	009815

报告期末下属分级基金的份额总额	7,800,031,053.08 份	156,413.94 份
-----------------	--------------------	--------------

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）	
	泰达宏利乐盈 66 个月定开债 A	泰达宏利乐盈 66 个月定开债 C
1. 本期已实现收益	73,582,878.50	1,433.53
2. 本期利润	73,582,878.50	1,433.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0094	0.0092
4. 期末基金资产净值	8,031,330,097.66	160,863.16
5. 期末基金份额净值	1.0297	1.0284

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。

#### 3.2 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

泰达宏利乐盈 66 个月定开债 A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.93%	0.01%	1.01%	0.01%	-0.08%	0.00%
过去六个月	1.88%	0.01%	2.03%	0.01%	-0.15%	0.00%
过去一年	3.68%	0.01%	4.08%	0.01%	-0.40%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.20%	0.01%	4.79%	0.01%	-0.59%	0.00%

泰达宏利乐盈 66 个月定开债 C

阶段	净值增长率①	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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

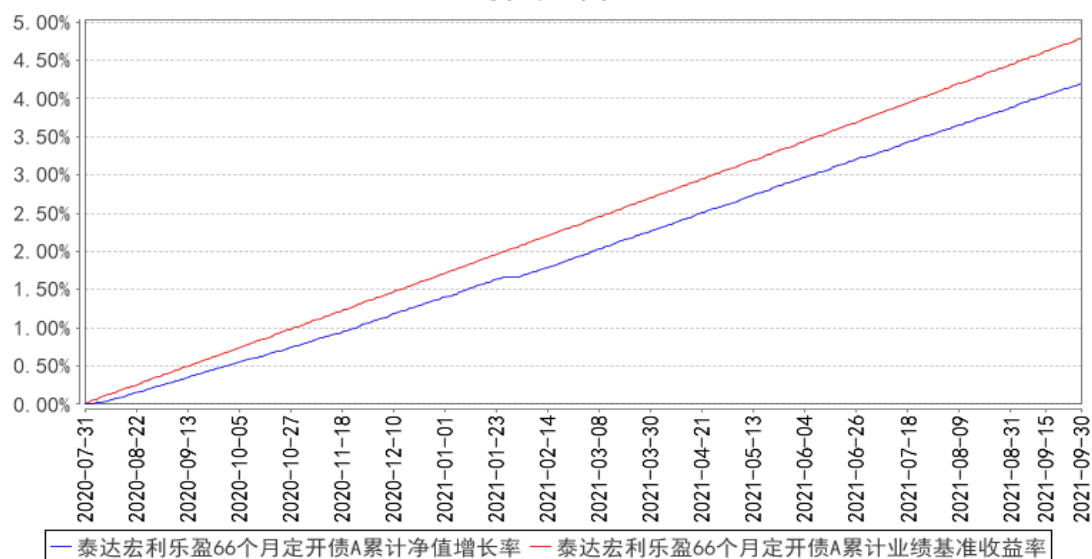
过去三个月	0.89%	0.01%	1.01%	0.01%	-0.12%	0.00%
过去六个月	1.82%	0.01%	2.03%	0.01%	-0.21%	0.00%
过去一年	3.57%	0.01%	4.08%	0.01%	-0.51%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.06%	0.01%	4.79%	0.01%	-0.73%	0.00%

注：在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的三年期银行定期存款利率（税后）+1.25%。

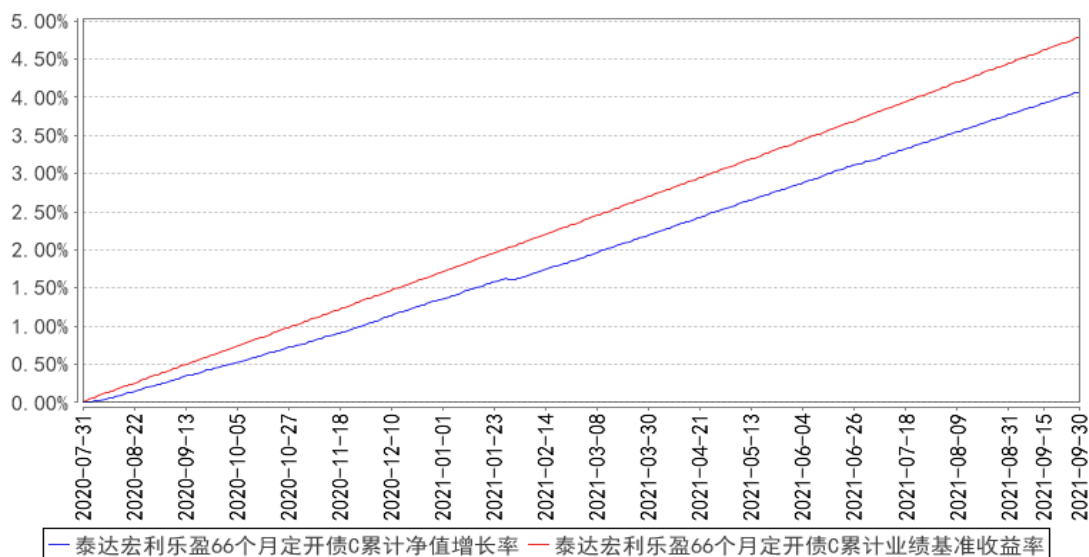
以三年期银行定期存款利率（税后）加基差作为本基金的业绩比较基准符合产品特性，能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征和流动性特征，合理衡量本基金的业绩表现。

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

泰达宏利乐盈66个月定开债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



泰达宏利乐盈66个月定开债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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宁霄	本基金基金经理	2021年3月1日	-	13年	中国人民大学金融工程硕士，2006年4月至2007年6月，任职于兴业全球基金管理有限公司基金运营部，担任基金清算；2007年8月至2011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；2013年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾先后担任交易员、交易主管、交易部总经理助理、基金经理助理，现任基金经理。具备13年证券从业经验，8年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
傅浩	固定收益部副总经理；基金经理	2020年7月31日	2021年9月9日	14年	华中科技大学理学硕士；2007年7月至2011年8月，任职于东兴证券研究所，担任固定收益研究员；2011年8月至2013年4月，任职于中邮证券有限责任公司，担任投资主办人；2013年5月至2014年4月，任职于民生证券股份有限公司，担任投资经理；2014年5月至2016年11月，任职于中加基金管理有限公司，担任投资经理；2016年11月加入泰达宏利基金管理有限公司，先后担任固定收益部基

					金经理助理、固定收益部总经理助理，现任固定收益部副总经理兼基金经理；具备 14 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 公平交易专项说明

### 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。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%，在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，经济下行压力略显，央行降准以降低实体融资成本。本季度出口继续维持韧性，但高基数压力显现；地产投资下行明显，基建仍受限于地方债发行节奏缓慢而增长乏力。货币政策方面，央行虽然降准，但基础货币不升反降。季末随着大量逆回购的投放，银行间资金面保持宽松局面。降准引导收益率中枢下行，但其后并没有强逻辑支持债市继续强势，市场陷入宽幅震

荡。

本组合主要以运用票息策略为主，重点投资于利率债品种，维持较高的杠杆比率，注重控制杠杆成本，以期保持组合的弹性。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末泰达宏利乐盈 66 个月定开债 A 基金份额净值为 1.0297 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.93%；截止至本报告期末泰达宏利乐盈 66 个月定开债 C 基金份额净值为 1.0284 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.89%；同期业绩比较基准收益率为 1.01%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,902,305,496.81	96.45
	其中：债券	12,902,305,496.81	96.45
	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	233,463,348.73	1.75
8	其他资产	241,262,062.71	1.80
9	合计	13,377,030,908.25	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

##### 5.2.2 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告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

本基金报告期末未持有股票投资。

#### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,902,653,353.90	123.30
	其中：政策性金融债	9,902,653,353.90	123.30
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	2,999,652,142.91	37.35
10	合计	12,902,305,496.81	160.65

注：本基金采用摊余成本法估值，表中所列公允价值为持仓债券的摊余成本金额。

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	160405	16 农发 05	72,300,000	7,232,582,954.80	90.05
2	150314	15 进出 14	15,100,000	1,541,160,342.31	19.19
3	171771	20 内蒙 24	7,500,000	744,641,297.35	9.27
4	180411	18 农发 11	5,500,000	562,564,079.92	7.00
5	160836	20 河南 31	5,260,200	522,008,935.51	6.50

注：本基金采用摊余成本法估值，表中所列公允价值为持仓债券的摊余成本金额。

### 5.6 报告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。

### 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 5.9.2 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。

### 5.9.3 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。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行于 2021 年 7 月 13 日曾受到银保监会公开处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	24,329.73
2	应收证券清算款	1,782,536.13
3	应收股利	-
4	应收利息	239,455,196.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	241,262,062.71

#### 5.10.4 报告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。

#### 5.10.5 报告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。

#### 5.10.6 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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利乐盈 66 个月定开债 A	泰达宏利乐盈 66 个月定 开债 C
报告期期初基金份额总额	7,800,031,053.08	156,413.94
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	7,800,031,053.08	156,413.94

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 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	1	20210701~20210930	2,199,999,000.00	-	-	2,199,999,000.00	28.20

构	2	20210701~20210930	2,999,999,000.00	-	-	2,999,999,000.00	38.46
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。							

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于 2021 年 9 月 23 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于总经理代为履行董事长职务的公告》，自 2021 年 9 月 22 日起，由总经理傅国庆先生代任公司董事长。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资人可登录中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 或者基金管理人互联网网站 (<http://www.mfcteda.com>) 查阅。

泰达宏利基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日