

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
报告送出日期：2018年7月19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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月17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请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。

本报告期为2018年4月1日至2018年6月30日。

§ 2 基金产品概况

本基金名称 泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金

交易代码 000387

基金运作方式 封闭式

基金份额首次发行日 2013年11月4日

报告期末基金份额总额 92,709,103.29份

报告期末基金资产净值 92,709,103.29元

报告期末基金份额净值 0.965元

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，通过长期的主动管理，力争获取高于业绩比较基准的稳定回报。

投资策略 从利率、信用、久期等角度分析不同类别的债券品种，精选具有较高流动性的债券品种，力争获取稳定的收益。

业绩比较基准 中债综合指数收益率(全价)

风险特征 本基金属中低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。

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

下属分级基金的基金简称 泰达宏利瑞利债券A 泰达宏利瑞利债券C

下属分级基金的交易代码 000387 000388

报告期末下属分级基金的份额总额 22,093,076.07份 69,616,496.06份

下属分级基金的基金资产净值 69,616,496.06元

下属分级基金的份额净值 0.965元

申购赎回费 0.00%

赎回费 0.00%

注：本基金的业绩比较基准为中债综合指数收益率(全价)

3.1 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)

1.本期已实现收益 -2,124,243.00

2.本期利润 -2,496,309.12

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0204

4.期末基金资产净值 79,082,416.19

5.期末基金份额净值 0.966

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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

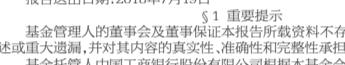
3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.11% 0.39% 1.01% 0.10% -4.12% 0.09%

注：本基金的业绩比较基准为中债综合指数收益率(全价)

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



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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.00% 0.07% -2.26% 0.40% -3.72% 0.05%

注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×35%+中债综合债券指数收益率×65%。

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

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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.00% 0.07% -2.26% 0.40% -3.72% 0.05%

注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×35%+中债综合债券指数收益率×65%。

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

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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.00% 0.07% -2.26% 0.40% -3.72% 0.05%

注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×35%+中债综合债券指数收益率×65%。

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

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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.00% 0.07% -2.26% 0.40% -3.72% 0.05%

注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×35%+中债综合债券指数收益率×65%。

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

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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.00% 0.07% -2.26% 0.40% -3.72% 0.05%

注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×35%+中债综合债券指数收益率×65%。

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

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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.00% 0.07% -2.26% 0.40% -3.72% 0.05%

注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×35%+中债综合债券指数收益率×65%。

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

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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.00% 0.07% -2.26% 0.40% -3.72% 0.05%

注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×35%+中债综合债券指数收益率×65%。

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

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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.00% 0.07% -2.26% 0.40% -3.72% 0.05%

注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×35%+中债综合债券指数收益率×65%。

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

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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.00% 0.07% -2.26% 0.40% -3.72% 0.05%

注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×35%+中债综合债券指数收益率×65%。

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

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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.00% 0.07% -2.26% 0.40% -3.72% 0.05%

注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×35%+中债综合债券指数收益率×65%。

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

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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.00% 0.07% -2.26% 0.40% -3.72% 0.05%

注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×35%+中债综合债券指数收益率×65%。

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

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