

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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人及银行份额有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月17日核对了本报告中的财务数据、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基金的招募说明书及其更新。

本报告财务数据未经审计。

本报告期间为2018年4月1日至2018年6月30日。

§ 2 基金产品概况

基金名称	泰达宏利纯利债券
交易代码	000707
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年1月10日
报告期末基金资产总额	100,000,000.00元
投资目标	在确保基金资产安全的前提下，力争创造高于业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金的纯利债券型投资基金将主要采取信用策略，同时加码美国保护政策，大幅压低全球金融市场风险偏好，叠加美联储加息并相对避险，美元快速升值，新兴市场明显承压。
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	100,000,000.00份
报告期末基金份额净值	1.0000元
报告期末下属分级基金的份额总额	200,012,371.27份
报告期末下属分级基金的净值	0.669808元

§ 3 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
泰达宏利纯利债券	泰达宏利纯利债券
1.本期实现收益	1,702,363.08
2.本期利润	2,472,333.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0124
4.期末基金份额净值	201,764,767.30
5.期末可供分配基金份额净值	0.6698

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,计价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 本基金份额份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰达宏利纯利债券A

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	差额百分比	①-③	②-④
过去三个月	1.22%	0.60%	1.01%	0.10%	0.21%	-0.04%

泰达宏利纯利债券C

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	差额百分比	①-③	②-④
过去三个月	1.16%	0.60%	1.01%	0.10%	0.14%	-0.04%

注:本基金业绩比较基准:中国债券综合指数收益率。

3.2.2 基金合同同生以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基

注:泰达宏利纯利债券A

泰达宏利纯利债券C

泰达宏利纯利债券A

泰达宏利纯利债券C