

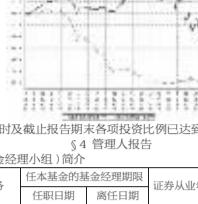
信息披露

Disclosure

泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)

2018年第二季度报告

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



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
王婧	固定收益部总经理、基金经理	2017年10月16日	11	盛大利耶大学财务与管理硕士，国际收支与外汇管理硕士，国际金融学士。曾任中国银行总行资金营运中心交易员，中国银行总行资金营运中心产品经理，中国银行总行资金营运中心高级产品经理，中国银行总行资金营运中心高级产品经理，担任基金经理；2010年3月至2012年3月，任中国银行总行资金营运中心产品经理，中国银行总行资金营运中心高级产品经理，担任基金经理；2012年3月至2014年4月，任中国银行总行资金营运中心高级产品经理，担任基金经理；2014年4月至2016年10月，任安邦保险基金管理有限公司基金经理，担任基金经理；2016年11月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理；2017年10月，担任本基金基金经理。具有11年证券从业经验，其中11年基金管理经验。

注：1.本基金管理人已公告基金转型起始日（2016年5月14日）

§ 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(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-6,767,168.16
2.本期利润	-3,936,214.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0399
4.期末基金份额净值	113,089,223.76
5.期末基金份额总额	0.097

注：1.本公司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)扣减相关费用后的余额，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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，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 本报告期内基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -3.24% 0.46% -0.27% 0.07% -2.97% 0.38%

注：1.本基金的业绩比较基准：中债企业债全价指数收益率*90%+中债国债总全价指数*10%。

2.本基金的业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.3 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.2.2 本基金合同生效以来基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.2.3 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.1 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.2 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.3 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.4 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.5 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.6 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.7 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.8 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.9 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.10 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.11 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.12 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.13 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.14 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.15 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.16 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.17 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.18 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.19 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。

3.3.20 本报告期内基金净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 -1.78% 0.22% 0.09% 0.01% -1.64% 0.21%

注：1.本基金的业绩比较基准：一年定期存款利率*2%。