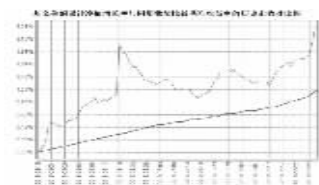


泰达宏利金利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第二季度报告



本基金成立于2018年3月19日,截止报告期末本基金仍在建仓期。

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任本基金基金经理日期	离任日期	证券从业年限	说明
王鹏	基金经理	2018年3月19日	-	11	清华大学统计学学士, 美国加州大学圣地亚哥分校金融学硕士, 固定收益部副总监。2007年11月至2010年12月, 任中信证券基金管理部研究员; 2010年12月至2012年1月, 任中信证券基金管理部副经理; 2012年1月至2014年4月, 任鹏华基金管理公司基金经理; 2014年4月至2015年12月, 任泰达宏利基金管理有限公司基金经理; 2015年12月至2016年10月, 任泰达宏利基金管理有限公司基金经理; 2016年10月至今, 任泰达宏利基金管理有限公司基金经理。具有11年证券从业经验, 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公告中的披露日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

部门运用交易系统设置的公平交易功能并按时间优先、价格优先的原则严格执行行

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 报告期内基金投资策略和运作分析

央行在报告期内两次降低商业银行存款准备金率, 对市场释放了大量的流动性。

同时, 市场对于未来降准的预期更加强烈。在股市调整加大的情况下, 中长期利率债

品种受到市场追捧, 短期下行幅度明显。信用债而言, 则呈现了不同的局面, 中低等

级信用债品种几乎完全丧失了流动性, 信用利差和流动性利差大幅走阔, 尤其是民营企

业和地方政府融资平台等发债主体。

本基金在报告期内逐步配置了商业银行金融债等高等级债券, 同时配置了部分

存款并在银行间开展了逆回购交易。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0118元; 本报告期基金份额净值增长率为

1.04%, 业绩比较基准收益率为1.76%。

4.6 报告期内基金持有人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二十个工作日基金份额持有人人数不满二百人或

者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
1.1	其中: 股票	-	-
2	基金投资	602,640,000.00	36.18
2.1	其中: 债券	602,640,000.00	36.18
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中: 债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
4.1	其中: 资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
5.1	其中: 买入返售金融资产	562,262,503.38	37.05
5.2	其中: 买入返售金融资产	-	-
6	其他资产	346,050,002.32	22.54
6.1	其中: 银行存款和结算备付金合计	7,552,746.69	0.47
6.2	其中: 其他资产	1,538,144,434.58	100.00
6.3	其中: 其他资产	-	-

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投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股投资股票。

5.3 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

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中国石化	126,103	1,276,704.46	1.26
2	中国石化	70,000	1,234,380.00	1.22
3	中国石化	200,000	1,162,000.00	1.15
4	中国石化	41,000	1,104,650.00	1.07
5	中国石化	202,600	1,061,424.00	1.05
6	中国石化	23,400	1,028,480.00	1.02
7	中国石化	1,375	1,004,204.88	1.03
8	中国石化	234,000	990,012.00	1.01
9	中国石化	57,500	982,011.72	1.00
10	中国石化	202,000	976,480.00	1.00

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

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股票投资明细

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债券投资明细

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贵金属投资明

细

5.9 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

5.10 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

5.11 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

5.12 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

5.13 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

5.14 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

5.15 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

5.16 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

5.17 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

5.18 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

5.19 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

5.20 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

5.21 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

5.22 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

5.23 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

5.24 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

5.25 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

5.26 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

5.27 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

5.28 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

5.29 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

5.30 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

5.31 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

5.32 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

5.33 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

5.34 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

5.35 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

5.36 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

5.37 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

5.38 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

5.39 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

5.40 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

5.41 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

5.42 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

5.43 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

5.44 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

5.45 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

5.46 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

5.47 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

5.48 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

5.49 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

5.50 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

5.51 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

5.52 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

5.53 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

5.54 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

5.55 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

5.56 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

5.57 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

5.58 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

5.59 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

5.60 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

5.61 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

5.62 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

5.63 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

5.64 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

5.65 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

5.66 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

5.67 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

5.68 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

5.69 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

5.70 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

5.71 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

5.72 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

5.73 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

5.74 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

5.75 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

5.76 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

5.77 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

5.78 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

5.79 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

5.80 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

5.81 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

5.82 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

5.83 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

5.84 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

5.85 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

5.86 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

5.87 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

5.88 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

5.89 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

5.90 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

5.91 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

5.92 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

5.93 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

5.94 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

5.95 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

5.96 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

5.97 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

5.98 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

5.99 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

5.100 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

5.101 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

5.102 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

5.103 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

5.104 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

5.105 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

5.106 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