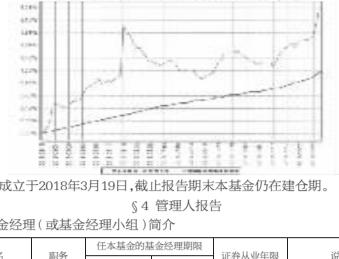


## 泰达宏利金利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2018年第二季度报告



本基金成立于2018年3月19日，截至报告期末本基金仍在建仓期。

## § 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间	证券从业年限
王靖	固有资金投资总监 基金经理 基金经理助理	2018年3月19日	11

说明：本基金由清华大学财务与管理系硕士、周易宏观研究员、基金经理，2007年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金运作部基金经理，2010年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2011年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2012年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2013年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2014年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2015年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2016年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2017年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2018年3月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理。

风险比较基准：本基金的业绩比较基准，即预期的定期风险低于货币市场基金，但高于货币市场基金和股票基金。

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。

§ 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 10,136,646.05

2.本期利润 11,498,846.79

3.期初至报告期的累计损益总额 60109

4.期末基金资产净值 1,522,948,367.24

5.期末基金份额净值 1.0118

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 本基金报告期内基金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 - ④ - ⑤ -

过去三个月 10.4% 0.02% 1.76% 0.15% -0.72% -0.13%

注：本基金的业绩比较基准为：中债总指数（全价）收益率。

中债总指数是样本本息券种，包括所有具有可比性的符合指数编制标准的债券，从总体债券指数中进行抽样选择债券编制而成，或以流动性调整所编制的债券指数均可称为可比指数，能客观反映一国或某一市场的债券总体情况。

故本基金选取中债总指数（全价）作为业绩比较基准。

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

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 - ④ - ⑤ -

过去三个月 -11.6% 1.31% -11.9% 1.31% 2.6% 0.00%

注：本基金业绩比较基准：中证500价格指数收益率\*95%+人民币一年定期存款基准利率\*5%。

3.2.3 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

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 - ④ - ⑤ -

过去三个月 -11.6% 1.31% -11.9% 1.31% 2.6% 0.00%

注：本基金业绩比较基准：中证500价格指数收益率\*95%+人民币一年定期存款基准利率\*5%。

3.2.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年二季度，整体市场逻辑围绕中国经济“去杠杆”为主脉络运行，整

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间 证券从业年限

王靖 固有资金投资总监  
基金经理  
基金经理助理 2018年3月19日 - 11

说明：本基金由清华大学财务与管理系硕士、周易宏观研究员、基金经理，2007年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金运作部基金经理，2010年6月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2011年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2012年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2013年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2014年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2015年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2016年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2017年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理，2018年3月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理。

风险比较基准：本基金的业绩比较基准，即预期的定期风险低于货币市场基金，但高于货币市场基金和股票基金。

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。

§ 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 - -

2 固定收益投资 - -

3 国定定期投资 602,640,000.00 39.18

4 中长期债券 - -

5 现金类投资 - -

6 其他投资 582,252,500.26 37.81

7 衍生工具( 含准备金 ) 346,059,092.32 22.50

8 其他资产 7,192,748.08 0.47

9 合计 1,538,144,434.68 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值( 元 ) 占基金资产净值比例( % )

1 农林牧渔业 - -

2 制造业 471,533,000.00 30.06

3 信息传输、软件和信息技术服务业 60,919,000.00 3.93

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 80,432,000.00 5.28

5 建筑业 60,675,000.00 3.93

6 交通运输、仓储和邮政业 3,700,000.00 0.24

7 银行 254,000.00 0.02

8 其他 60,000.00 0.01

9 合计 602,640,000.00 39.18

5.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

序号 行业类别 公允价值( 元 ) 占基金资产净值比例( % )

1 信息技术 - -

2 医药生物 2,231,176.12 0.15

3 制造业 39,131,467.40 2.65

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 2,563,000.00 1.76

5 建筑业 1,142,290.00 0.78

6 交通运输、仓储和邮政业 4,889,700.75 0.67

7 采掘业 2,336,541.00 0.33

8 信息传输、软件和信息技术服务业 136,762.00 0.01

9 金融业 6,096,790.00 0.45

10 房地产业 1,047,485.00 0.07

11 商业贸易 3,296,577.28 0.23

12 银行 610,970.20 0.04

13 信息技术 - -

14 医药生物 610,970.20 0.03

15 电子元件 515,000.00 0.03

16 采掘业 40,691,230.71 2.66

17 信息技术 - -

18 医药生物 - -

19 采掘业 - -

20 信息技术 - -

21 医药生物 - -

22 采掘业 - -

23 信息技术 - -

24 医药生物 - -

25 采掘业 - -

26 信息技术 - -

27 医药生物 - -

28 采掘业 - -

29 信息技术 - -

30 医药生物 - -

31 采掘业 - -

32 信息技术 - -

33 医药生物 - -

34 采掘业 - -

35 信息技术 - -

36 医药生物 - -

37 采掘业 - -

38 信息技术 - -

39 医药生物 - -

40 采掘业 - -

41 信息技术 - -

42 医药生物 - -

43 采掘业 - -

44 信息技术 - -

45 医药生物 - -

46 采掘业 - -

47 信息技术 - -

48 医药生物 - -

49 采掘业 - -

50 信息技术 - -

51 医药生物 - -

52 采掘业 - -

53 信息技术 - -

54 医药生物 - -

55 采掘业 - -

56 信息技术 - -

57 医药生物 - -

58 采掘业 - -

59 信息技术 - -

60 医药生物 - -

61 采掘业 - -

62 信息技术 - -

63 医药生物 - -

64 采掘业 - -

65 信息技术 - -

66 医药生物 - -

67 采掘业 - -

68 信息技术 - -

69 医药生物 - -

70 采掘业 - -

71 信息技术 - -

72 医药生物 - -

73 采掘业 - -

74 信息技术 - -

75 医药生物 - -

76 采掘业 - -

77 信息技术 - -

78 医药生物 - -

79 采掘业 - -

80 信息技术 - -