泰达宏利亚洲债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年 6 月 30 日

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

送出日期:2018 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司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。本半年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

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 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文, 投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利亚洲债券（QDII）	
基金主代码	003463	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年 10 月 14 日	
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	
报告期末基金份额总额	91, 251, 800.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称;	泰达宏利亚洲债券（QDII）A	泰达宏利亚洲债券（QDII）C
下属分级基金的交易代码:	003463	003464
报告期末下属分级基金的份额总额	86, 261, 913.08 份	4, 989, 887.18 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面, 寻找各类债券的投资机会, 在谨慎投资的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金为债券型的 QDII 基金,密切跟踪相关国家或地区经济的景气周期以及财政、货币政策变化,把握市场利率水平的运行态势,从宏观层面了解亚洲各国家、行业的景气情况,协同系统性的宏观经济,政治以及信用风险,从而确定基金资产在不同国家、不同行业以及不同债券品种之间的配置比例。
业绩比较基准	摩根大通亚洲信用指数总报酬（JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return）*95%+ 中国人民银行公告人民币活期存款基准利率 *5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期的风险水平和预期收益都要低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	袁静	王永民
	联系电话	010－66577513	010- 66594896
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400- 698- 8888	95566
传真		010－66577666	010- 66594942
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		弓劲梅	陈四清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China（Hong Kong）Limited
	中文	-	中国银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http: // www.mfcteda.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金份额	泰达宏利亚洲债券（QDII）A	泰达宏利亚洲债券（QDII）C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	- 17, 227, 329.89	- 555, 605.67
本期利润	- 14, 242, 063.33	- 318, 793.52
加权平均基金份额本期利润	- 0.0684	- 0.0595
本期加权平均净值利润率	- 7.06%	- 6.19%
本期基金份额净值增长率	- 5.16%	- 5.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	- 6, 847, 875.62	- 428, 460.85
期末可供分配基金份额利润	- 0.0794	- 0.0859
期末基金资产净值	82, 395, 944.11	4, 732, 131.37
期末基金份额净值	0.9552	0.9483
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	- 4.48%	- 5.17%

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基金份额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. 期末可供分配利润等于期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰达宏利亚洲债券(QDII)A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.38%	0.29%	- 0.51%	0.07%	0.89%	0.22%
过去三个月	- 0.76%	0.28%	- 1.13%	0.11%	0.37%	0.17%
过去六个月	- 5.16%	0.27%	- 2.41%	0.11%	- 2.75%	0.16%
过去一年	- 6.20%	0.23%	- 0.65%	0.10%	- 5.55%	0.13%
自基金合同生效起至今	- 4.48%	0.22%	0.60%	0.14%	- 5.08%	0.08%

泰达宏利亚洲债券(QDII)C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.30%	0.29%	- 0.51%	0.07%	0.81%	0.22%
过去三个月	- 0.92%	0.28%	- 1.13%	0.11%	0.21%	0.17%
过去六个月	- 5.43%	0.27%	- 2.41%	0.11%	- 3.02%	0.16%
过去一年	- 6.59%	0.23%	- 0.65%	0.10%	- 5.94%	0.13%
自基金合同生效起至今	- 5.17%	0.22%	0.60%	0.14%	- 5.77%	0.08%

本基金业绩比较基准:摩根大通亚洲信用指数总报酬(JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return)*95%+ 中国人民银行公告人民币活期存款基准利率 *5%。

上述摩根大通亚洲信用指数总报酬代表该指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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: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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司,成立于 2002 年 6 月,是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司:51%;宏利资产管理(香港)有限公司:49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利宏达混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京天宝货币市场基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)、泰达宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式,即通过整个投资团队全体人员的共同努力,力求实现基金财产的持续增值。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李安杰	本基金基金经理	2016年 10 月 14 日	-	10	台湾成功大学财务金融硕士,CFA,2008 年 7 月至 2014 年 4 月,就职于国泰人寿保险股份有限公司,负责海外债券投资;2014 年 5 月至 2016 年 1 月,就职于国泰证券投资信托股份有限公司,担任台湾地区固泰投信－新兴市场高收益债基金经理;2016 年 2 月加盟泰达宏利基金管理有限公司国际业务部,现任基金经理;具有 10 年证券投资管理经验,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相关公告中披露的日期。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金没有聘请境外投资顾问。

4.3 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以及基金合同的约定,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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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内部控制流程,严格执行相关制度规定。在投资管理活动中,公平对待不同投资组合,确保各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;在交易环节实行集中交易制度,交易部运用交易系统中的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令,确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易,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。

4.4.2 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。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处罚的情况。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 上半年亚洲债市面临基准利率上扬与信用利差扩大的负面挑战,美元兑人民币汇率则呈现先贬后升的走势。投资组合主要透过美国公债期货与仓位调整,投资组合久期始终保持于基准指标之下,藉以降低利率上扬的不利影响。高收益债则是信用利差扩大的主要来源,本投资组合向来以投资级债券为主,高收益级债券为辅,同时于年初时大幅减码印度尼西亚债券占比,一来减少受部分信用利差大幅增加的债券拖累,二来在近期违约事件频传下,投资组合整体信用仍保持相当水平,持有债券亦未面临任何违约相关负面消息。人民币兑美元汇率于上半年初持续升值,投资组合基于保守的态度,期间进行了汇率风险对冲操作;随着人民币贬值趋势显现,投资组合便不再进行汇率对冲操作,因此对净值提供了提振的效果。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利亚洲债券 (QDII)A 基金份额净值为 0.9552 元,本报告期基金份额净值增长率为 -5.16%;截至本报告期末泰达宏利亚洲债券(QDII)C 基金份额净值为 0.9483 元,本报告期基金份额净值增长率为 -5.43%;同期业绩比较基准收益率为 -2.41%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年在美联储加息预期、新兴市场货币贬值、境内去杠杆与违约事件接连发行的冲击下,整体市场面临较大的压力,带动亚洲债市收益率上扬。目前美国经济相对偏强,支持美联储继续加息,但利率曲线倒挂与外围市场压力渐增,预期利率上扬速度将明显放缓。亚洲债市信用利差扩大主要有二大因素:第一为外国投资占比较高的国家,如印度与印度尼西亚,在美元明显升值时,该国美元资金往往具有快速流出倾向,表现在这些国家的信用债上,不论债券信用好坏强弱,价券价格通常因大量卖压而明显下跌。第二为中国境内去杠杆与信用事件渐增,拖累了中资投资人信心与市场流动性。下半年新兴市场货币仍有续贬可能,但实际提供了投资人进场低价买进债信良好的目标,另一方面境内由去杠杆转为稳杠杆,整体流动性可能改善,但信用违约事件无可避免。基本面支持人民币贬值,但影响因子较多,短线人行态度、资本流动状况、中美贸易议题皆将对汇率产生影响,汇率的波动几率较大。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定,设有估值委员会,并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管基金运营的副总经理担任主任,成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人;委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论,发表相关意见和建议,但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内,本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及基金实际运作的情况,本基金本报告期内未进行利润分配。目前无其他利润分配安排。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在泰达宏利亚洲债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的 "金融工具风险及管理" 部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:泰达宏利亚洲债券型证券投资基金

报告截止日:2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年 6 月 30 日	上年度末 2017年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	12, 995, 096.23	22, 498, 327.90
结算备付金	1, 388, 458.64	1, 844, 576.43
存出保证金	7, 000, 000.00	15, 240, 131.85
交易性金融资产	89, 947, 968.75	277, 601, 910.02
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	89, 947, 968.75	277, 601, 910.02
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	1, 292, 067.75	3, 116, 862.79
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	112, 623, 591.37	320, 301, 808.99

负债和所有者权益	本期末 2018年 6 月 30 日	上年度末 2017年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	6, 029, 800.00	-
应付赎回款	19, 170, 214.38	4, 426, 966.77
应付管理人报酬	97, 018.07	275, 077.45
应付托管费	24, 254.53	68, 769.36
应付销售服务费	1, 544.59	2, 343.73
应付交易费用	-	-
应交税费	14, 155.82	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	158, 528.50	275, 322.32
负债合计	25, 495, 515.89	5, 048, 479.63
所有者权益:		
实收基金	91, 251, 800.26	313, 043, 061.59
未分配利润	- 4, 123, 724.78	2, 210, 267.77
所有者权益合计	87, 128, 075.48	315, 253, 329.36
负债和所有者权益总计	112, 623, 591.37	320, 301, 808.99

报告截止日 2018 年 6 月 30 日,基金份额总额 91,251,800.26 份,其中下属 A 类基金份额 86,261,913.08 份,C 类基金份额 4,989,887.18 份。下属 A 类基金份额净值 0.9552 元,C 类基金份额净值 0.9483 元。

6.2 利润表

会计主体:泰达宏利亚洲债券型证券投资基金

本报告期:2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	- 13, 113, 892.41	11, 269, 736.08
1.利息收入	4, 497, 760.65	13, 207, 933.19
其中:存款利息收入	84, 020.82	285, 979.11
债券利息收入	4, 413, 739.83	12, 921, 954.08
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	- 20, 034, 074.66	5, 362, 245.47
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	- 18, 024, 416.49	5, 362, 245.47
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	- 2, 009, 658.17	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	3, 222, 078.71	- 5, 975, 689.22
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	- 933, 453.94	- 1, 708, 963.79
5.其他收入（损失以"-"号填列）	133, 796.83	384, 210.43
减:二、费用	1, 446, 964.44	4, 031, 894.92
1、管理人报酬	1, 026, 323.60	3, 084, 838.39
2、托管费	256, 580.91	771, 209.58
3、销售服务费	10, 182.13	38, 763.63
4、交易费用	5, 209.92	194.31
5、利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6、税金及附加	23, 622.77	-
7、其他费用	125, 045.11	136, 889.01
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	- 14, 560, 856.85	7, 237, 841.16
减:所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	- 14, 560, 856.85	7, 237, 841.16

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利亚洲债券型证券投资基金

本报告期:2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	313, 043, 061.59	2, 210, 267.77	315, 253, 329.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	- 14, 560, 856.85	- 14, 560, 856.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	- 221, 791, 261.33	8, 226, 864.30	- 213, 564, 397.03
其中:1.基金申购款	292, 864.34	- 11, 523.95	281, 340.39
2.基金赎回款	- 222, 084, 125.67	8, 238, 388.25	- 213, 845, 737.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	91, 251, 800.26	- 4, 123, 724.78	87, 128, 075.48

项目	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	698, 402, 253.26	7, 049, 646.13	705, 451, 899.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	7, 237, 841.16	7, 237, 841.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	- 255, 227, 948.99	- 6, 245, 666.85	- 261, 473, 615.84
其中:1.基金申购款	44, 667, 214.36	1, 226, 772.03	45, 893, 986.39
2.基金赎回款	- 299, 895, 163.35	- 7, 472, 438.88	- 307, 367, 602.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	443, 174, 304.27	8, 041, 820.44	451, 216, 124.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____ 刘建 _____ _____ 傅国庆 _____ _____ 王泉 _____

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰达宏利亚洲债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2016]2074 号《关于准予泰达宏利亚洲债券型证券投资基金注册的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 698,402,253.26 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 10 月 14 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 698,402,253.26 份基金份额,募集期间有效认购款项未产生利息。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行"),境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司(以下简称"中国银行(香港)")。

根据《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据基金认购 / 申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购 / 申购时收取认购 / 申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购 / 申购费用的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值, 计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金; 银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不主动参与股票等权益类资产的投资。本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%,投资于亚洲债券的比例不低于非现金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为摩根大通亚洲信用指数总报酬 (JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return)X95%+ 中国人民银行公告人民币活期存款基准利率 X5%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2018 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称 "企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号 < 年度报告和半年度报告 >》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金基金合同》 和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（"中国银行"）	基金托管人、基金代销机构
中国银行(香港)有限公司（"中国银行(香港)"）	基金境外托管人

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中国银行(香港)	8, 308, 905.91	2.24%	12, 498, 659.12	1.42%

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行基金交易。

6.4.8.1.5 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1, 026, 323.60	3, 084, 838.39
其中:支付销售机构的客户维护费	244, 069.86	940, 261.76

注: 支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.0% / 当年天数;

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	256, 580.91	771, 209.58

注: 支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售服务