

## 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年第三季度报告

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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介			
姓名	职务	任职日期及离任日期	证券从业年限
孙宇	基金经理	2018年3月19日至今	11

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披露的日期。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。

4.3 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,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;交易所运用交易系统中设置的公平交易功能并按照规定优先、价格优先的原则严格执行所有指令;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。

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 报告期内本基金投资策略和运作分析

回顾三季度,央行通过降准和MLF等工具释放大量流动性,在银行信贷投放风险偏好仍维持低位,市场资金流向实体经济薄弱,银行间市场整体流动性保

持宽松态势,短端利率维持低位,一年期股份级银行存单一度发行利率低于3%。

在中美贸易摩擦加剧,国内实体经济复苏依然在艰难筑底的一片悲观预期下,虽然国内月度经济数据犹存希望,中长期利率依然在低位徘徊。

本基金在三季度继续寻找可投资高等级信用金融债和商业银行信贷资产。三季度本基金业绩表现超越业绩比较基准,主要原因在于中短端利率维持低位,3年期高等级信用品种受市场追捧。

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1.0126元;本报告期基金份额净值增长率为1.37%,业绩比较基准收益率为0.17%。

4.6 报告期内本基金持有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 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	固定收益投资	915,007,500.00	60.01
	其中:国债	915,007,500.00	60.01
4	银行存款	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	569,558,444.33	36.90
	其中:买入返售金融资产-银行承兑票据	-	-
7	银行存款和拆借金融资产合计	8,201,340.70	0.58
8	其他资产	11,330,267.49	0.74
9	合计	1,538,798,552.52	100.00

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通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	783,441,500.00	51.40
4	企业债	-	-
5	地方政府债	80,148,000.00	5.26
6	中期票据	80,896,000.00	5.29
7	短期融资券	50,930,000.00	3.34
8	可转债	-	-
9	其他	-	-
9	合计	915,007,500.00	60.04

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1628005	18国债01	1,000,000	100,616,000.00	6.60
2	1822016	18国债02	800,000	81,646,000.00	5.36
3	1828019	18国债02	800,000	81,252,000.00	5.33
4	1820022	18国债01	800,000	81,176,000.00	5.33
5	011810346	18国债01	800,000	80,696,000.00	5.29

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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.9.3 本期国债期货投资评价

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.10.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	应收股利	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	11,330,267.49
5	其他	-
9	合计	11,330,267.49

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	应付证券清算款	-
2	应付利息	-
3	应付股利	-
4	应付赎回款	726.70
5	其他应付款	112,068.50
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	130,079.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明