泰达宏利纯利债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年3月27日

§1 重要提示

本基金管理人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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月25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。

本报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利纯利债券	
基金主代码	003767	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月25日	
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	
报告期末基金份额总额	195,975,033.75份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰达宏利纯利债券A	泰达宏利纯利债券C
下属分级基金的交易代码:	003767	003768
报告期末下属分级基金的份额总额	195,966,307.83份	8,725.92份

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求基金资产安全的前提下,力争创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金的固定收益类资产投资将主要采取信用策略,同时辅之以目标久期调整策略、收益率曲线策略、信用利差配置策略等,并且对于资产支持证券等特殊债券品种将采用针对性投资策略。
业绩比较基准	中国债券综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券市场中的较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	袁静	刘晔
	联系电话	010-66577513	010-66223695
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	liuye1@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-698-8888	95526
传真		010-66577666	010-66226045

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年		2017年		2016年11月25日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	泰达宏利纯利债券A	泰达宏利纯利债券C	泰达宏利纯利债券A	泰达宏利纯利债券C	泰达宏利纯利债券A	泰达宏利纯利债券C
本期已实现收益	8,222,411.40	384.78	6,731,812.79	817.25	488,953.30	917.69
本期利润	10,172,478.74	490.74	5,332,312.31	707.73	488,953.30	917.69
加权平均基金份额本期利润	0.0505	0.0471	0.0267	0.0306	0.0024	0.0021
本期基金份额净值增长率	5.12%	4.82%	2.66%	2.50%	0.24%	0.21%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0283	0.0244	0.0061	0.0052	0.0024	0.0021
期末基金资产净值	202,036,205.73	8,962.17	201,233,469.48	12,768.74	200,496,953.30	427,942.28
期末基金份额净值	1.0310	1.0271	1.0061	1.0052	1.0024	1.0021

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

泰达宏利纯利债券A

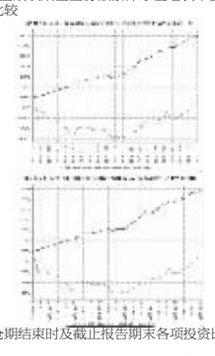
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.18%	0.03%	1.99%	0.05%	-0.81%	-0.02%
过去六个月	2.20%	0.04%	2.57%	0.06%	-0.37%	-0.02%
过去一年	5.12%	0.05%	4.79%	0.07%	0.33%	-0.02%
自基金合同生效起至今	8.18%	0.04%	-0.56%	0.08%	8.74%	-0.04%

泰达宏利纯利债券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
过去三个月	1.09%	0.03%	1.99%	0.05%	-0.90%	-0.02%
过去六个月	2.05%	0.04%	2.57%	0.06%	-0.52%	-0.02%
过去一年	4.82%	0.05%	4.79%	0.07%	0.03%	-0.02%
自基金合同生效起至今	7.67%	0.04%	-0.56%	0.08%	8.23%	-0.04%

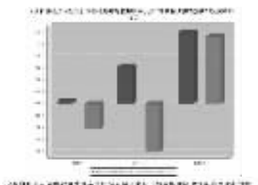
注:本基金业绩比较基准:中国债券综合指数收益率。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同生效日为2016年11月25日,2016年度净值增长率的计算期间为2016年11月25日至2016年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

泰达宏利纯利债券A

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.2600	5,200,317.91	3.64	5,200,321.55	
2017	0.2300	4,600,259.40	2.76	4,600,262.16	
2016	-	-	-	-	
合计	0.4900	9,800,577.31	6.40	9,800,583.71	

单位:人民币元

泰达宏利纯利债券C

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.2600	427.56	6.76	434.32	
2017	0.2200	273.42	5.94	279.36	
2016	-	-	-	-	
合计	0.4800	700.98	12.70	713.68	

§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:天津市泰达国际控股(集团)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、泰达宏利泽利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)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		
丁宇佳	本基金基金经理	2016年11月25日	-	10	中央财经大学理学学士;2008年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理、固定收益部总经理助理兼基金经理等职。具备10年基金从业经验,10年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
王靖	本基金基金经理助理;固定收益部副总经理	2017年3月8日	-	11	澳大利亚国立大学财务管理硕士;2007年11月至2010年3月,任职于华夏基金管理有限公司基金运作部,担任基金会计;2010年3月至2012年3月,任职于华融证券股份有限公司资产管理部,担任投资经理;2012年3月至2014年4月,任职于国盛证券有限责任公司资产管理总部,担任投资经理;2014年5月至2016年6月,任职于北信瑞丰基金管理有限公司,担任固定收益部总监兼基金经理;2016年6月至2016年10月,任职安邦基金管理有限公司(筹),担任固定收益投资部副总经理;2016年11月加入泰达宏利基金管理有限公司,现任固定收益部副总经理兼基金经理;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相关公告中披露的日期。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面,对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内,交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发,未发现明显的非公平交易指令;基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;场外交易的交易价格与市场价格一致,场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后,处于正常范围之内;基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内,本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

4.3.3 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,风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析,定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估,定期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。如发现疑似异常交易情况,相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,美国经济在前三季度领跑全球,四季度出现增速拐点,但在流动性收缩的背景下,全球经济普遍呈现放缓趋势,金融市场风险偏好持续降低。而国内方面,全年央行货币政策保持宽松,宏观上金融数据率先出现较大幅度回落,经济数据在四季度出现加速下滑的端倪,经济下行压力近一步显现。

债券市场收益率一路下行,三季度受到宏观数据反弹以及地方债放量等因素影响有小幅反弹,总体全年呈现明显牛平格局,信用利差在年末也出现一定程度的收缩,但债券违约事件数量较前一年明显增加。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利纯利债券A基金份额净值为1.0310元,本报告期基金份额净值增长率为5.12%;截至本报告期末泰达宏利纯利债券C基金份额净值为1.0271元,本报告期基金份额净值增长率为4.82%;同期业绩比较基准收益率为4.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年,经济下行压力较大,但宏观政策明显从去杠杆转向稳增长,将在一定程度上保证经济不出现失速风险。在流动性充裕的背景下,预计股票和债券市场都会呈现震荡上涨的格局。由于资本利得空间较小,票息策略重新占据上风,转债或迎来较好的投资机会。

4.6 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。公司估值委员会主任由主管基金运营的副总经理担任,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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同及基金的实际运作的情况,本基金管理人于2018年6月20日公告,A类按每10份基金份额派发0.2600元进行收益分配,共分配5,200,321.55元;B类按每10份基金份额派发0.2600元进行收益分配,共分配434.32元。权益登记日、除权日为2018年6月21日,红利发放日为2018年6月22日。

4.8 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

1、本基金从2018年8月22日至2018年11月19日出现连续超过20个工作日但不满60个工作日基金份额持有人数量低于200人的情形。

2、报告期内,本基金未出现连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。

§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,本基金托管人在托管泰达宏利纯利债券型证券投资基金(以下称"本基金")的过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,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,本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核,对本基金的投资运作进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、收益分配情况、投资组合报告的内容("金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内),保证复核内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第23418号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰达宏利纯利债券型证券投资基金全体基金份额持有人:
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了泰达宏利纯利债券型证券投资基金(以下简称"泰达宏利纯利债券基金")的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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,公允反映了泰达宏利纯利债券基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰达宏利纯利债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	泰达宏利纯利债券基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估泰达宏利纯利债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算泰达宏利纯利债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督泰达宏利纯利债券基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对泰达宏利纯利债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致泰达宏利纯利债券基金不能持续经营。 (五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 / 庞伊君
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
审计报告日期	2019年3月26日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体:泰达宏利纯利债券型证券投资基金
报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	361,515.42	1,317,672.83
结算备付金	301,838.34	259,090.91
存出保证金	-	-
交易性金融资产	210,692,000.00	186,231,000.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	210,692,000.00	186,231,000.00
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	-	10,000,135.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	3,081,914.36	3,774,729.97
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	214,437,268.12	201,582,628.71
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31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	11,999,862.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	51,352.94	51,996.55
应付托管费	17,117.64	17,332.17
应付销售服务费	2.17	3.37
应付交易费用	8,481.15	1,058.40
应交税费	-	-
应付利息	9,284.32	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	306,000.00	266,000.00
负债合计	12,392,100.22	336,390.49
所有者权益:		
实收基金	195,975,033.75	200,025,079.77
未分配利润	6,070,134.15	1,221,158.45
所有者权益合计	202,045,167.90	201,246,238.22
负债和所有者权益总计	214,437,268.12	201,582,628.71

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额总额195,975,033.75份,其中A类基金份额净值1.0310元,基金份额总额195,966,307.83份;C类基金份额净值1.0271元,基金份额总额8,725.92份。

7.2 利润表
会计主体:泰达宏利纯利债券型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	11,432,411.57	6,448,956.24
1.利息收入	7,835,709.66	8,031,672.37
其中:存款利息收入	72,192.98	1,616,329.77
债券利息收入	7,424,791.73	4,767,845.83
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	338,724.95	1,647,496.77
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,621,005.00	-183,210.00
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,621,005.00	-183,210.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	1,950,173.30	-1,399,610.00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	25,523.61	103.87
减:二、费用	1,259,442.09	1,115,936.20
1. 管理人报酬	614,188.55	610,616.55
2. 托管费	204,729.57	203,538.82
3. 销售服务费	31.14	74.82
4. 交易费用	7,135.26	1,575.00
5. 利息支出	85,553.75	5,697.92
其中:卖出回购金融资产支出	85,553.75	5,697.92
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	347,803.82	294,433.09
三、利润总额 (亏损总额以"-"号填列)	10,172,969.48	5,333,020.04
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	10,172,969.48	5,333,020.04

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:泰达宏利纯利债券型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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)	200,025,079.77	1,221,158.45	201,246,238.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,172,969.48	10,172,969.48
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)	-4,050,046.02	-123,237.91	-4,173,283.93
其中:1.基金申购款	195,970,479.07	4,037,028.40	200,007,507.47
2.基金赎回款	-200,020,525.09	-4,160,266.31	-204,180,791.40
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)	-	-5,200,755.87	-5,200,755.87
五、期末所有者权益(基金净值)	195,975,033.75	6,070,134.15	202,045,167.90
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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)	200,435,024.59	489,870.99	200,924,895.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,333,020.04	5,333,020.04
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)	-409,944.82	-1,191.06	-411,135.88
其中:1.基金申购款	6,626.47	101.66	6,728.13
2.基金赎回款	-416,571.29	-1,292.72	-417,864.01
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)	-	-4,600,541.52	-4,600,541.52
五、期末所有者权益(基金净值)	200,025,079.77	1,221,158.45	201,246,238.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰达宏利纯利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]2572号《关于核准泰达宏利纯利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《泰达宏利纯利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200,426,000.00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1485号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利纯利债券型证券投资基金基金合同》于2016年11月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,435,024.59份基金份额,其中认购资金利息折合9,024.59份基金份额。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:北京银行股份有限公司(以下简称"北京银行")。

根据《泰达宏利纯利债券型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利纯利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、赎回时根据持有期限收取赎回费用,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、赎回时根据持有期限收取赎回费用的,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。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利纯利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具。本基金所指固定收益类金融工具包括企业债券、公司债券、短期融资券、地方政府债券、商业银行金融债券、商业银行次级债、资产支持证券、逆回购、国债、中央银行票据、政策性金融债券、中期票据、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的固定收益类金融工具。本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为中国债券综合指数收益率。

7.4.2 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》、《泰达宏利纯利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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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