

# 泰达宏利溢利债券型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017 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：北京银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 年 1 月 22 日（基金合同生效日）起至 2017 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            | 泰达宏利溢利债券         |            |
| 基金主代码           | 003793           |            |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |            |
| 基金合同生效日         | 2017 年 1 月 22 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      | 996,797,252.46 份 |            |
| 基金合同存续期         | 不定期              |            |
| 下属分级基金的基金简称:    | 泰达宏利溢利债券 A       | 泰达宏利溢利债券 C |
| 下属分级基金的交易代码:    | 003793           | 003794     |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 996,795,505.50 份 | 1,746.96 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   | 本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，结合定量分析方法，确定资产在非信用类固定收益类证券（国债、中央银行票据、政策性金融债等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。本基金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   | 陈沛              | 赵姝                          |
|         | 联系电话 | 010-66577808    | 010-66223695                |
|         | 电子邮箱 | irm@mfcteda.com | liuyel@bankofbeijing.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-69-88888    | 95526                       |
| 传真      |      | 010-66577666    | 010-66226045                |

## 2.4 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

| 基金级别          | 泰达宏利溢利债券 A                           | 泰达宏利溢利债券 C                             |
|---------------|--------------------------------------|--|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017 年 1 月 22 日-2017 年 6 月 30 日) | 报告期(2017 年 1 月 22 日 - 2017 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 12,569,447.64                        | 27.06                                  |
| 本期利润          | 14,499,661.55                        | 30.41                                  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0184                               | 0.0162                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.78%                                | 1.64%                                  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017 年 6 月 30 日)                |  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0018                               | 0.0015                                 |
| 期末基金资产净值      | 1,000,547,046.61                     | 1,752.85                               |
| 期末基金份额净值      | 1.0038                               | 1.0034                                 |

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. 对期末可供分配利润，采用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；

4. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日。

### 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

泰达宏利溢利债券 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    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.51%    | 0.02%       | 0.90%      | 0.06%         | -0.39% | -0.04% |
| 过去三个月 | 1.11%    | 0.02%       | -0.88%     | 0.08%         | 1.99%  | -0.06% |

|            |       |       |        |       |       |        |
|------------|-------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 1.78% | 0.02% | -1.81% | 0.08% | 3.59% | -0.06% |
|------------|-------|-------|--------|-------|-------|--------|

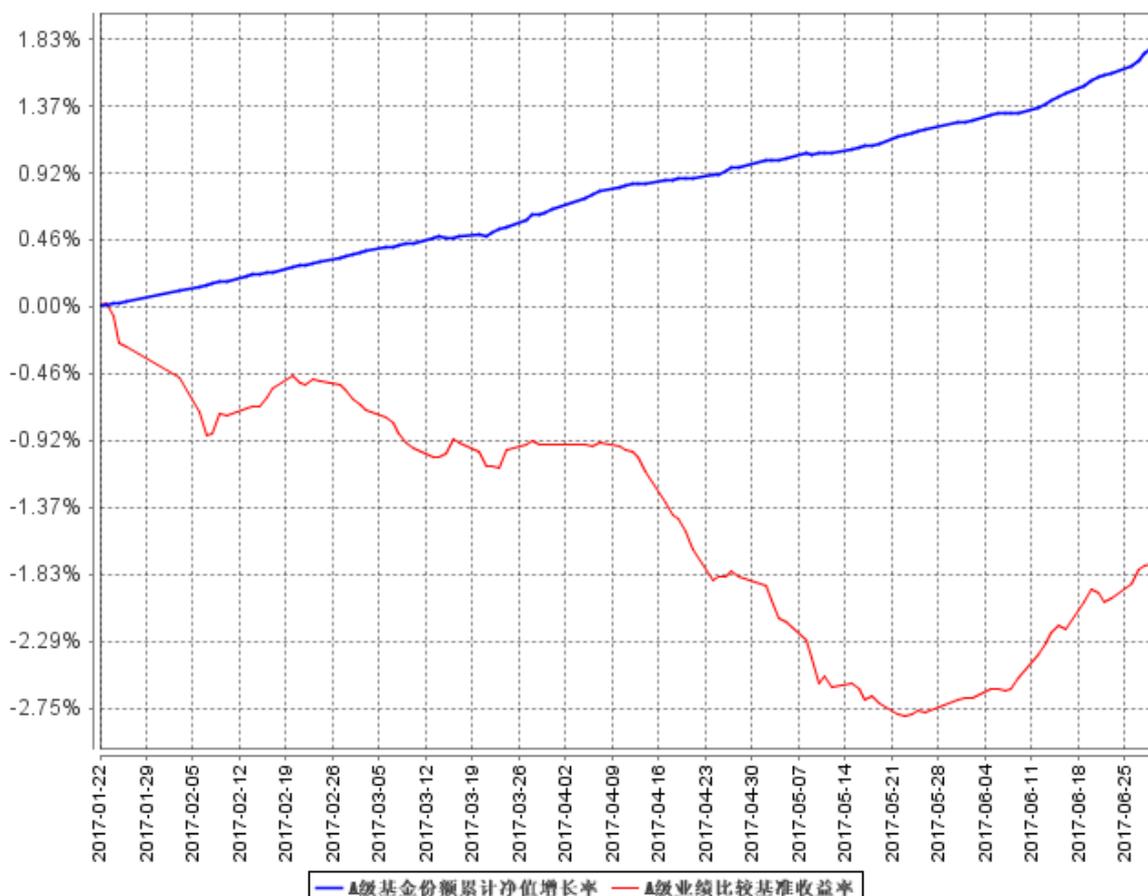
泰达宏利溢利债券 C

| 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.48%    | 0.02%       | 0.90%      | 0.06%         | -0.42% | -0.04% |
| 过去三个月      | 1.03%    | 0.02%       | -0.88%     | 0.08%         | 1.91%  | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.64%    | 0.02%       | -1.81%     | 0.08%         | 3.45%  | -0.06% |

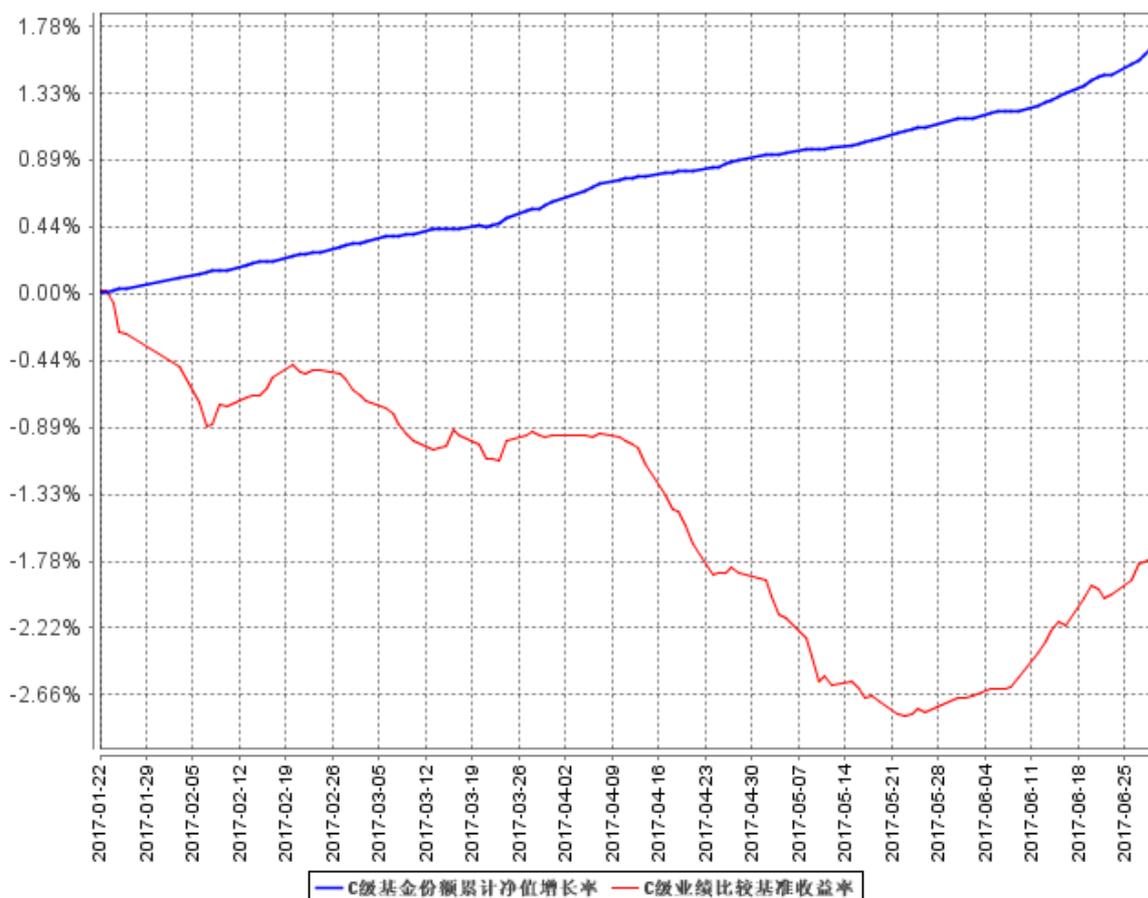
注：本基金业绩比较基准：中国债券综合指数收益率。

### 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



**C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



注：本基金成立于 2017 年 1 月 22 日，按基金合同规定，自基金合同生效起六个月内为建仓期。截止报告期末本基金仍在建仓期。

## § 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、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、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、泰达宏利收益增强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、泰达宏利养老收益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、泰达宏利多元回报债券型证券投资基金、泰达宏利增利灵活配置定期开放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、泰达宏利启迪灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启泽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 |        |   |
| 庞宝臣 | 本基金基金经理 | 2017 年 1 月 22 日 | -    | 11     | 理学硕士；2006 年 7 月至 2011 年 8 月，任职于永安财产保险股份有限公司，担任投资经理，负责债券研究与投资工作；2011 年 9 月至 2012 年 8 月，任职于幸福人寿保险股份有限公司，担任高级经理、固定收益投资室负责人，负责债券投 |

|    |           |                 |   |   |  |
|----|-----------|-----------------|---|---|--|
|    |           |                 |   |   | 资工作；2012 年 9 月至 2014 年 9 月，任职于中华联合保险股份有限公司投资管理部，担任高级主管一职；2014 年 9 月至 2016 年 3 月 7 日，任职于中华联合保险控股股份有限公司，担任投资经理一职；2016 年 3 月 10 日加入泰达宏利基金管理有限公司，担任固定收益部基金经理一职；具备 11 年证券投资基金管理经验，具有基金从业资格。   |
| 傅浩 | 本基金基金经理助理 | 2017 年 3 月 28 日 | - | 9 | 理学硕士；2007 年 7 月至 2011 年 8 月，任职于东兴证券研究所，担任固定收益研究员；2011 年 8 月至 2013 年 4 月，任职于中邮证券股份有限责任公司，担任投资主办人；2013 年 5 月至 2014 年 4 月，任职于民生证券股份有限公司，担任投资经理；2014 年 5 月至 2016 年 11 月，任职于中加基金管理有限公司固定收益部，担任投资经理；2016 年 11 月 29 日加入泰达宏利基金管理有限公司，担任固定收益部基金经理助理；现任基金经理。具备 9 年证券投资基金管理经验，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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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；交易部运用交易系统中设置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；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。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况共出现了 5 次，未发现异常。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 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，发达经济体复苏态势日渐清晰，美联储加息两次，全球货币政策转入收缩，推动全球经济体无风险利率震荡回升；国内出口改善，工业生产平稳，消费需求稳定，物价小幅上升，非金融企业现金流和利润继续改善。

在经济环境相对良好、增长韧性相对强的窗口期，政府宏观调控着重于控金融风险，监管政策超出投资者预期，债券市场受到较大冲击，市场波动显著扩大，收益率曲线平坦化上行，信用债受到的冲击更大，各等级信用利差回升至中位数以上水平。

报告期内，我们认为基本面边际变化不大，市场核心变量在于政策，在目前情况下，债券市场缺乏赚取资本利得的机会，弹性不足，但票息水平已到相对高位，配置价值显现，市场机会在于个券定价的挖掘；基于市场情况以及本基金特征，我们采取了低杠杆、中性久期、精选个券的投资策略。

### 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溢利债券 A 基金份额净值为 1.0038 元，自成立以来基金份额净值增长率为 1.78%；截至本报告期末泰达宏利溢利债券 C 基金份额净值为 1.0034 元，自成立以来基金份额净值增长率为 1.64%；同期业绩比较基准收益率为-1.81%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，国际货币基金组织六年来首次上调全球经济增长预测，预计世界经济出现较大范围的扩张，国内经济面临相对有利的外部条件；供给侧改革保护了工业企业合理的利润空间，居民可支配收入平稳增长，投资消费具备持续性。

债券市场方面，平坦的收益率曲线已经反映了增长指标技术下行，在防范金融风险的调控导向下，货币政策转向宽松的可能性较低；虽然当前债券估值水平具备配置价值，但在负债竞争环境下，金融机构负债成本上升有提高资产收益的需求，市场收益率呈现震荡调整的可能性更大，票息、套息交易、短久期仍然是相对占优的策略。

#### 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。

#### 4.7 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 2017 年 6 月 21 日公告对本基金基金收益进行分配，权益登记日、除权日为 2017 年 6 月 23 日，红利发放日为 2017 年 6 月 26 日，A 类按每 10 份基金份额派发 0.1400 元进行收益分配，共分 13,955,137.09 元；C 类按每 10 份基金份额派发 0.1300 元进行收益分配，共分配 22.98 元。

#### 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

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，本基金托管人在托管泰达宏利溢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关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

本托管人复核了本报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利溢利债券型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

| 资产         | 本期末<br>2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| <b>资产：</b> |                   |
| 银行存款       | 1,114,838.56      |
| 结算备付金      | -                 |
| 存出保证金      | -                 |
| 交易性金融资产    | 1,022,959,000.00  |
| 其中：股票投资    | -                 |
| 基金投资       | -                 |
| 债券投资       | 1,022,959,000.00  |
| 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   | 150,000,345.00    |

|                 |                           |
|-----------------|---------------------------|
| 应收证券清算款         | -                         |
| 应收利息            | 11,647,764.66             |
| 应收股利            | -                         |
| 应收申购款           | -                         |
| 递延所得税资产         | -                         |
| 其他资产            | -                         |
| 资产总计            | 1,185,721,948.22          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2017年6月30日</b> |
| <b>负 债:</b>     |                           |
| 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       | 184,669,522.99            |
| 应付证券清算款         | -                         |
| 应付赎回款           | -                         |
| 应付管理人报酬         | 248,559.03                |
| 应付托管费           | 82,853.03                 |
| 应付销售服务费         | 0.46                      |
| 应付交易费用          | 9,799.13                  |
| 应交税费            | -                         |
| 应付利息            | 50,785.32                 |
| 应付利润            | -                         |
| 递延所得税负债         | -                         |
| 其他负债            | 111,628.80                |
| 负债合计            | 185,173,148.76            |
| <b>所有者权益:</b>   |                           |
| 实收基金            | 996,797,252.46            |
| 未分配利润           | 3,751,547.00              |
| 所有者权益合计         | 1,000,548,799.46          |
| 负债和所有者权益总计      | 1,185,721,948.22          |

注：1、报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额总额 996,797,252.46 份，其中下属 A 类基金份额 996,795,505.50 份，C 类基金份额 1,746.96 份。下属 A 类基金份额净值 1.0038 元，C 类基金份额净值 1.0034 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利溢利债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 22 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 本期                               |
|----------------------------|----------------------------------|
|                            | 2017 年 1 月 22 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| <b>一、收入</b>                | 16,266,612.47                    |
| 1.利息收入                     | 14,212,147.81                    |
| 其中：存款利息收入                  | 2,905,712.37                     |
| 债券利息收入                     | 8,993,994.51                     |
| 资产支持证券利息收入                 | -                                |
| 买入返售金融资产收入                 | 2,312,440.93                     |
| 其他利息收入                     | -                                |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 124,247.40                       |
| 其中：股票投资收益                  | -                                |
| 基金投资收益                     | -                                |
| 债券投资收益                     | 124,247.40                       |
| 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）      | 1,930,217.26                     |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                                |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | -                                |
| <b>减：二、费用</b>              | 1,766,920.51                     |
| 1. 管理人报酬                   | 1,025,751.45                     |
| 2. 托管费                     | 341,917.19                       |
| 3. 销售服务费                   | 2.77                             |
| 4. 交易费用                    | 8,325.00                         |
| 5. 利息支出                    | 273,294.83                       |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 273,294.83                       |
| 6. 其他费用                    | 117,629.27                       |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | 14,499,691.96                    |
| 减：所得税费用                    | -                                |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | 14,499,691.96                    |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利溢利债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 22 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2017 年 1 月 22 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)                        | 200,009,560.19                         | -              | 200,009,560.19   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)              | -                                      | 14,499,691.96  | 14,499,691.96    |
| 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)      | 796,787,692.27                         | 3,207,015.11   | 799,994,707.38   |
| 其中：1.基金申购款                             | 796,788,112.21                         | 3,207,017.73   | 799,995,129.94   |
| 2.基金赎回款                                | -419.94                                | -2.62          | -422.56          |
| 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) | -                                      | -13,955,160.07 | -13,955,160.07   |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 996,797,252.46                         | 3,751,547.00   | 1,000,548,799.46 |

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：

|                               |                                |                               |
|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| <u>          刘建          </u> | <u>          傅国庆          </u> | <u>          王泉          </u> |
| 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

泰达宏利溢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]2639 号《关于核准泰达宏利溢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《泰达宏利溢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 200,001,226.86 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(2017)第 019 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利溢利债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,009,560.19 份基金份额,其中认购资金利息折合 8,333.33 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《泰达宏利溢利债券型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利溢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、销售服务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（以下简称“溢利 A”）；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（以下简称“溢利 C”）。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《泰达宏利溢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。

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 2017 年 8 月 28 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》、《泰达宏利溢利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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 2017 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日的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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终

止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### **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**

本基金本报告期内无会计政策的变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期内无会计估计的变更。

#### **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[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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

#### 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 |
| 北京银行股份有限公司（“北京银行”） | 基金托管人               |

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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期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<br>2017年1月22日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,025,751.45                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                                    |

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 0.15% 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 0.15% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2017年1月22日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|----------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 341,917.19                           |

注：支付基金托管人北京银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称   | 本期<br>2017 年 1 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |           |      |
|------------------|---|-----------|------|
|                  | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                |           |      |
|                  | 泰达宏利溢利债券A                                       | 泰达宏利溢利债券C | 合计   |
| 泰达宏利基金管理有限<br>公司 | -   | 2.77      | 2.77 |
| 合计               | 0.00  | 2.77      | 2.77 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金基金份额前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金基金份额销售服务费=C 类基金基金份额前一日基金资产净值 X 0.30%/ 当年天数。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017 年 1 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |           |
|-------|---|-----------|
|       | 期末余额  | 当期利息收入    |
| 北京银行  | 1,114,838.56                                    | 28,539.02 |

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，按约定利率计息。

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新股或增发而于期末持有的流通受限证券。

### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 184,669,522.99 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称           | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|-----------|----------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 011759039 | 17 杭金投 SCP004  | 2017 年 7 月 4 日 | 100.31 | 415,000   | 41,628,650.00  |
| 011762016 | 17 海淀国资 SCP001 | 2017 年 7 月 4 日 | 100.24 | 500,000   | 50,120,000.00  |
| 111793401 | 17 张家口银行 CD004 | 2017 年 7 月 4 日 | 97.75  | 500,000   | 48,875,000.00  |
| 111793458 | 17 吉林银行 CD026  | 2017 年 7 月 4 日 | 97.75  | 500,000   | 48,875,000.00  |
| 合计        |                |                |        | 1,915,000 | 189,498,650.00 |

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

## 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1

日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 固定收益投资            | 1,022,959,000.00 | 86.27         |
|    | 其中：债券             | 1,022,959,000.00 | 86.27         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | 150,000,345.00   | 12.65         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,114,838.56     | 0.09          |
| 7  | 其他各项资产            | 11,647,764.66    | 0.98          |
| 8  | 合计                | 1,185,721,948.22 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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资产。

#### 7.2.2 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。

### 7.3 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。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金报告期内未进行股票买卖交易。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金报告期内未进行股票买卖交易。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |   |
|--------------|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | - |
| 卖出股票收入（成交）总额 | - |

本基金报告期内未进行股票买卖交易。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 49,760,000.00    | 4.97         |
|    | 其中：政策性金融债 | 49,760,000.00    | 4.97         |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 681,084,000.00   | 68.07        |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | 292,115,000.00   | 29.20        |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,022,959,000.00 | 102.24       |

### 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称   | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 011698745 | 16 鲁黄金 | 800,000 | 80,208,000.00 | 8.02         |

|   |           |                   |         |               |      |
|---|-----------|-------------------|---------|---------------|------|
|   |           | SCP013            |         |               |      |
| 2 | 011759039 | 17 杭金投<br>SCP004  | 500,000 | 50,155,000.00 | 5.01 |
| 3 | 011762016 | 17 海淀国资<br>SCP001 | 500,000 | 50,120,000.00 | 5.01 |
| 4 | 011760030 | 17 农垦 SCP004      | 500,000 | 50,095,000.00 | 5.01 |
| 4 | 041754017 | 17 闽漳龙<br>CP001   | 500,000 | 50,095,000.00 | 5.01 |
| 5 | 041760010 | 17 建安投资<br>CP001  | 500,000 | 50,075,000.00 | 5.00 |

### 7.7 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。

### 7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

#### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

#### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1

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。

#### 7.11.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 11,647,764.66 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 11,647,764.66 |

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末未持有股票投资。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别       | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额     | 持有人结构          |         |          |         |
|------------|----------|---------------|----------------|---------|----------|---------|
|            |          |               | 机构投资者          |         | 个人投资者    |         |
|            |          |               | 持有份额           | 占总份额比例  | 持有份额     | 占总份额比例  |
| 泰达宏利溢利债券 A | 20       | 49,839,775.28 | 996,795,316.73 | 100.00% | 188.77   | 0.00%   |
| 泰达宏利溢利债券   | 172      | 10.16         | 0.00           | 0.00%   | 1,746.96 | 100.00% |

|    |     |              |                |         |          |       |
|----|-----|--------------|----------------|---------|----------|-------|
| C  |     |              |                |         |          |       |
| 合计 | 192 | 5,191,652.36 | 996,795,316.73 | 100.00% | 1,935.73 | 0.00% |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别       | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 泰达宏利溢利债券 A | 129.22    | 0.0000%  |
|                  | 泰达宏利溢利债券 C | 260.00    | 14.8830% |
|                  | 合计         | 389.22    | 0.0000%  |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 份额级别       | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 泰达宏利溢利债券 A | 0                 |
|                                | 泰达宏利溢利债券 C | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 泰达宏利溢利债券 A | 0                 |
|                                | 泰达宏利溢利债券 C | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 泰达宏利溢利债券 A     | 泰达宏利溢利债券 C |
|--------------------------------|----------------|------------|
| 基金合同生效日（2017 年 1 月 22 日）基金份额总额 | 200,007,522.19 | 2,038.00   |
| 本报告期期初基金份额总额                   | -              | -          |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额          | 796,787,993.25 | 118.96     |

|                                    |                |          |
|------------------------------------|----------------|----------|
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 9.94           | 410.00   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | -              | -        |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 996,795,505.50 | 1,746.96 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1. 本报告期基金管理人未受到任何稽查或处罚。  
2. 本报告期内, 本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

| 券商名称 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 |
|------|------|-----------|
|------|------|-----------|

|      | 交易单元数量 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 备注 |
|------|--------|------|--------------|----|------------|----|
| 银河证券 | 2      | -    | -            | -  | -          | -  |

注：（一）本基金交易单元均为成立时新增

（二）交易单元选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- （1）经营规范，有较完备的内控制度；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要；
- （3）能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                |                | 报告期末持有基金情况 |                |         |
|--|----------------|-------------------------|----------------|----------------|------------|----------------|---------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额           | 赎回份额       | 持有份额           | 份额占比    |
| 机构   | 1              | 20170122-20170630       | 200,007,333.33 | 796,787,983.40 | 0.00       | 996,795,316.73 | 100.00% |
| 产品特有风险   |                |                         |                |                |            |                |         |
| 报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。 |                |                         |                |                |            |                |         |

- 1、报告期内，申购份额含红利再投资份额。
- 2、份额占比按照保留小数点后四位数为 99.9998%。

泰达宏利基金管理有限公司  
2017 年 8 月 28 日