

# 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 年年度报告

2018 年 12 月 31 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：2019 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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 3 月 19 日（基金合同生效日）起至 2018 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
8.6 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.....	46
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46

8.8	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 .....	46
8.9	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 .....	46
8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
8.11	投资组合报告附注 .....	47
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
9.3	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 .....	48
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	48
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	49
11.2	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 .....	49
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
11.4	基金投资策略的改变 .....	49
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
11.8	其他重大事件 .....	50
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
12.1	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 .....	51
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§13</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
13.1	备查文件目录 .....	52
13.2	存放地点 .....	52
13.3	查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	泰达宏利金利债券
基金主代码	005753
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 19 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	1,505,194,602.65 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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	1、封闭期投资策略 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。 2、开放期投资策略 开放期内，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，本基金将保持合理的组合流动性水平，尽可能降低规模变动对基金净值产生的影响。
业绩比较基准	中债总指数（全价）收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，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@mfteda.com	liuyel@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-698-8888	95526
传真		010-66577666	010-66226045
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	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
办公地址		北京市西城区金融大街 7	北京市西城区金融大街丙 17 号

	号英蓝国际金融中心南楼 三层	
邮政编码	100033	100033
法定代表人	弓劲梅	张东宁

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.mfcteda.com">http:// www.mfcteda.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	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
注册登记机构	泰达宏利基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

### § 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 3 月 19 日 (基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	38,574,498.80
本期利润	67,699,614.63
加权平均基金份额本期利润	0.0505
本期加权平均净值利润率	4.99%
本期基金份额净值增长率	4.87%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末
期末可供分配利润	11,314,296.31
期末可供分配基金份额利润	0.0075
期末基金资产净值	1,545,486,450.14
期末基金份额净值	1.0268
3.1.3 累计期末指标	2018 年末
基金份额累计净值增长率	4.87%

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

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	2.25%	0.07%	2.91%	0.09%	-0.66%	-0.02%
过去六个月	3.65%	0.05%	3.08%	0.10%	0.57%	-0.05%
自基金合同生效起至今	4.87%	0.04%	5.54%	0.12%	-0.67%	-0.08%

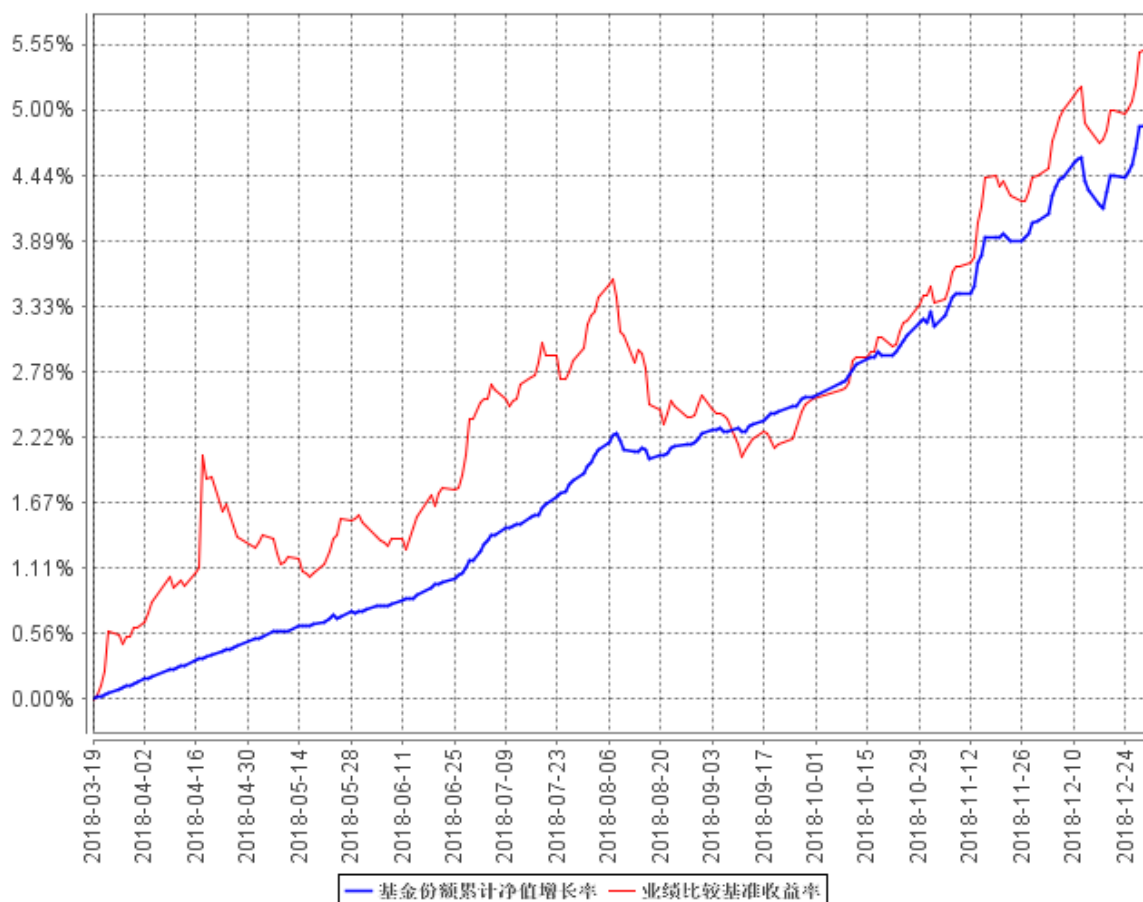
注：本基金的业绩比较基准为：中债总指数（全价）收益率。

中债总指数是全样本债券指数，包括市场上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，或给以流动性调整所编制的债券指数均可称为可复制指数，能客观反映一国或地区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）

收益率作为业绩比较基准。

### 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

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

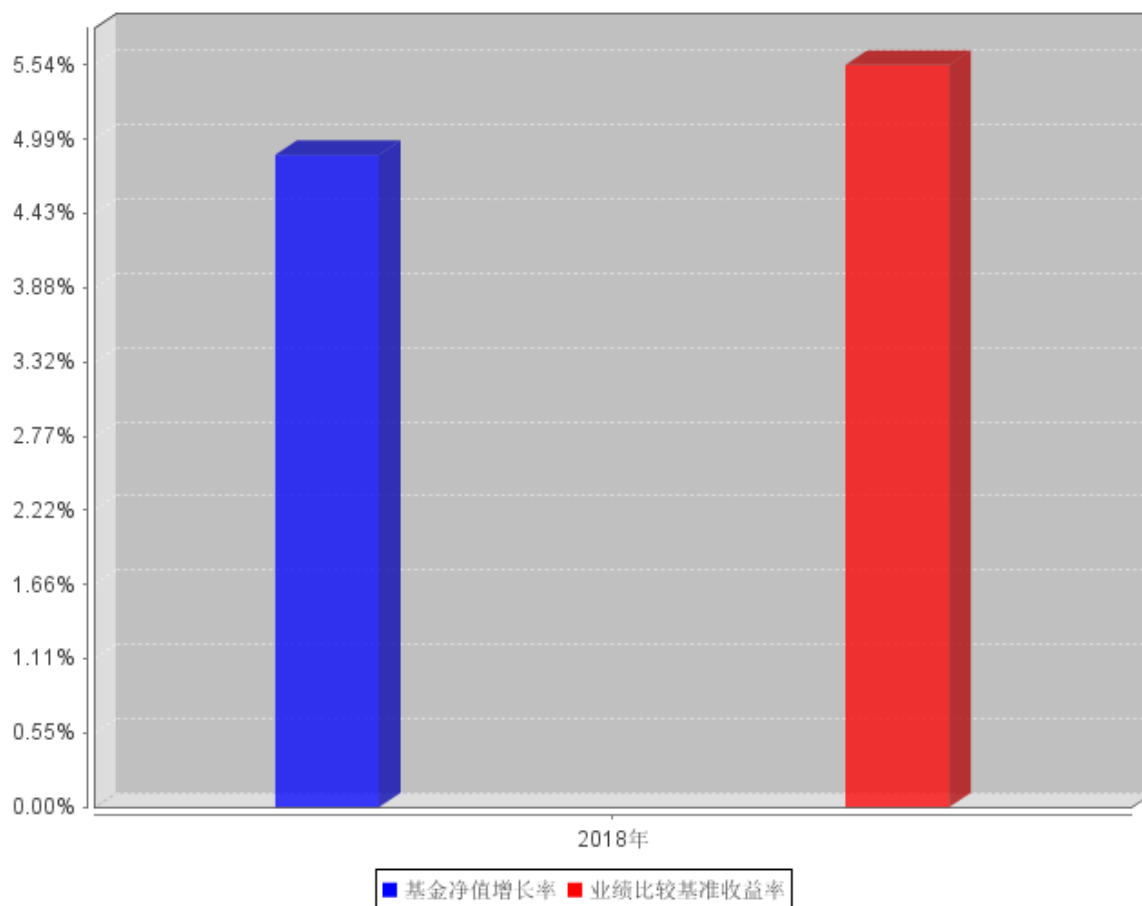


注：本基金成立于 2018 年 3 月 19 日，截止报告期末本基金成立不满一年。按基金合同规定，自基金合同生效日起六个月内为建仓期。本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。



### 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

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对比图



注：本基金成立日期为 2018 年 3 月 19 日，2018 年度净值增长率的计算期间为 2018 年 3 月 19 日至 2018 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

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	0.2140	32,211,164.49	-	32,211,164.49	
合计	0.2140	32,211,164.49	-	32,211,164.49	

## § 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		
王靖	固定收益部副总经理；基金经理	2018年3月19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；具备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内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。

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，贸易保护主义抬头叠加全球流动性收紧，全球经济呈放缓态势，美国经济虽然一度一枝独秀，但年末也出现放缓迹象，受制于外部环境，出口回落明显；内需方面，由于整肃地方政府债务以及非政府部门负债率约束，投资与消费支出也趋于弱势，经济下行态势显现。

经济走弱，货币政策由稳健转变为合理充裕，流动性极大改善，资金价格降至低位，但信用债违约不断，金融机构高度规避信用风险，利率债和高等级信用债需求最好，无风险利率陡峭化下移，信用利差分化，长端利率债表现最好。报告期内，本组合主要投资于 3 年期以内高等级信用债与利率债品种，虽然我们也通过杠杆方式增加了组合久期，但组合久期仍低于指数。

##### 4.4.2 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 1.0268 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.87%，业绩比较基准收益率为 5.54%。

#### 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，结构性因素与周期性因素共振，经济下行确定性高，市场利率水平虽然已回落至相对低位，但债券市场仍然面临较好的投资环境。货币政策、监管政策友好，虽然降息受到中美利差收窄的一定制约，但降准空间仍大，资金成本有望进一步回落，金融机构信用扩张动力不足叠加融资需求有限，长短利差仍有压缩空间；信用方面，风险仍处在暴露期，需要等待企业经营明确改善。总体而言，预计无风险利率震荡下行可能性更大，超额收益可能来自于对长端利率波动的把握，本产品相对关注回撤风险，但更侧重于骑乘策略，交易性机会的介入将会相对保守。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，督察长、监察稽核部、风险管理部定期与不定期的对基金的投资、交易、研发、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；在证券投资交易前由研究部门建立可供投资的基础库并定期进行全面维护更新和适时对个股进行维护更新，通过信息技术建立多级投资交易预警系统，并把禁选股票排除在交易系统之外；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；引入外方股东在风险控制方面的先进经验，完善公司风险管理指标及

流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司董事会及外部监管部门。

#### **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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金基金合同及基金的实际运作的情况，本基金本报告期管理人共分两次对本基金收益进行收益分配，每 10 份基金份额共计派发 0.214 元，共分配收益 32,211,164.49 元。

#### **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，本基金托管人在托管泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金（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 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 23430 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	泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“泰达宏利金利债券基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间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。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>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金利债券基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰达宏利金利债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泰达宏利金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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估泰达宏利金利债券</p>



	<p>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金利债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰达宏利金利债券基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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金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金利债券基金不能持续经营。</p>

	<p>(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。</p> <p>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。</p>	
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：泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	1,606,040.28
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,971,189,500.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,971,189,500.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	130,000,395.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	39,882,420.59
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		2,142,678,355.87
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		595,288,747.06
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		392,067.62
应付托管费		130,689.21
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	30,755.09
应交税费		27,233.30
应付利息		1,082,413.45

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	240,000.00
负债合计		597,191,905.73
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,505,194,602.65
未分配利润	7.4.7.10	40,291,847.49
所有者权益合计		1,545,486,450.14
负债和所有者权益总计		2,142,678,355.87

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0268 元，基金份额总额 1,505,194,602.65 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2018 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2018 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2018 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		75,403,124.42
1. 利息收入		47,028,153.12
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,119,494.26
债券利息收入		27,499,939.59
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		8,408,719.27
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-750,144.53
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-750,144.53
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	29,125,115.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-
<b>减：二、费用</b>		7,703,509.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,200,477.55
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,066,825.86
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	15,437.50
5. 利息支出		3,141,387.52
其中：卖出回购金融资产支出		3,141,387.52
6. 税金及附加		14,040.16
7. 其他费用	7.4.7.20	265,341.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		67,699,614.63
<b>减：所得税费用</b>		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		67,699,614.63

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2018 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 19 日（基金合同生效日）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）	1,009,999,000.00	-	1,009,999,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	67,699,614.63	67,699,614.63
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）	495,195,602.65	4,803,397.35	499,999,000.00
其中：1. 基金申购款	495,195,602.65	4,803,397.35	499,999,000.00
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-32,211,164.49	-32,211,164.49
五、期末所有者权益（基金净值）	1,505,194,602.65	40,291,847.49	1,545,486,450.14

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：

<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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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(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[2018]336 号《关于准予泰达宏利金利 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《泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,009,999,000.00 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(2018)第 0151 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于 2018 年 3 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,009,999,000.00 份基金份额,未产生有效的认购资金利息折份额。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”)。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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、金融债券、次级债券、资产支持证券、债券回购、国债、中央银行票据、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其他金融工具。本基金不买入股票或权证,不投资可转换债券和可交换债券。本基金的投资组合比例为:在封闭期内,本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%。在每个开放期的前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内,本基金投资不受上述比例限制。在开放期内,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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;封闭期不受此限制。本基金的业绩比较基准为中债总指数(全价)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》、《泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式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 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 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变动计入当期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。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进



行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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及由基金管理人缴纳的增值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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得

的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	1,606,040.28
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	1,606,040.28

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	1,942,064,384.17	1,971,189,500.00	29,125,115.83
	合计	1,942,064,384.17	1,971,189,500.00	29,125,115.83
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,942,064,384.17	1,971,189,500.00	29,125,115.83	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	130,000,395.00	-
合计	130,000,395.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未进行买断式逆回购交易。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应收活期存款利息	353.32
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	39,682,961.22
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	199,106.05
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	39,882,420.59

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	30,755.09
合计	30,755.09

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	240,000.00
合计	240,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,009,999,000.00	1,009,999,000.00
本期申购	495,195,602.65	495,195,602.65
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,505,194,602.65	1,505,194,602.65

注：1. 若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金于 2018 年 3 月 15 日公开发售，共募集有效净认购资金人民币 1,009,999,000.00 元，折合为 1,009,999,000.00 份基金份额。根据《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招募说明书》的规定，本基金设立募集期内有效认购资金按实际适用年利率计算未产生有效的利息折份额。

3. 根据《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基金合同》、《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招募说明书》及《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开放申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2018 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 19 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自

2018 年 6 月 20 日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	38,574,498.80	29,125,115.83	67,699,614.63
本期基金份额交易产生的变动数	4,950,962.00	-147,564.65	4,803,397.35
其中：基金申购款	4,950,962.00	-147,564.65	4,803,397.35
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-32,211,164.49	-	-32,211,164.49
本期末	11,314,296.31	28,977,551.18	40,291,847.49

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	102,463.76
定期存款利息收入	10,987,030.56
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	29,999.94
合计	11,119,494.26

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2018年3月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债	-750,144.53

转股及债券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-750, 144. 53

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年3月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付) 成交总额	406, 973, 543. 97
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付) 成本总额	402, 138, 401. 92
减：应收利息总额	5, 585, 286. 58
买卖债券差价收入	-750, 144. 53

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资申购差价收入。



### 7.4.7.15 衍生工具收益

#### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益-其他投资收益。

### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年3月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	29,125,115.83
——股票投资	-
——债券投资	29,125,115.83
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	29,125,115.83

### 7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年3月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	15,437.50
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-

合计	15,437.50
----	-----------

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年3月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
审计费用	90,000.00
信息披露费	150,000.00
其他	850.00
账户维护费	13,500.00
银行费用	10,991.20
合计	265,341.20

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于2019年2月22日宣告2019年度第1次分红，向截至2019年2月25日止在本基金注册登记人泰达宏利基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利0.1350元。

##### 7.4.9 关联方关系

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
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东(自2006年4月21日至2018年12月17日止)
天津市泰达国际控股(集团)有限公司	基金管理人的股东(自2018年12月18日起)
宏利资产管理(香港)有限公司	基金管理人的股东

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联交易单元进行股票交易。

### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行债券交易。

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行债券回购交易。

### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行权证交易。

### 7.4.10.1.5 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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,200,477.55
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 0.30%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,066,825.86

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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2018年3月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日			
银行间市场交	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购

易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
北京银行	-	-	-	-	143,100,000.00	22,572.10

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	
	2018年3月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
基金合同生效日(2018年3月19日)持有的基金份额	10,000,000.00	
期初持有的基金份额	10,000,000.00	
期间申购/买入总份额	-	
期间因拆分变动份额	0.00	
减:期间赎回/卖出总份额	0.00	
期末持有的基金份额	10,000,000.00	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.6644%	

- 注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额；  
2. 本基金管理人投资本基金时所适用的费率为本基金基金合同中约定的费率。

##### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末	
	2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
北京银行股份有限公司资金运营中心	1,495,194,602.65	99.3356%

注：本基金关联方投资本基金时所适用的费率为本基金基金合同中约定的费率。

#### 7.4.10.5 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 2018年3月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
北京银行	1,606,040.28	102,463.76

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2018年10月25日	-	2018年10月25日	0.0840	12,643,634.66	-	12,643,634.66	
2	2018年7月26日	-	2018年7月26日	0.1300	19,567,529.83	-	19,567,529.83	
合计	-	-		0.2140	32,211,164.49	-	32,211,164.49	

#### 7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31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595,288,747.06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
180204	18 国开 04	2019 年 1 月 3 日	104.72	1,330,000	139,277,600.00
180211	18 国开 11	2019 年 1 月 3 日	101.33	1,685,000	170,741,050.00
180211	18 国开 11	2019 年 1 月 9 日	101.33	3,210,000	325,269,300.00
合计				6,225,000	635,287,950.00

#### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其预期收益和预期风险低于股票基金和混合基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要是具有良好流动性的固定收益类金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行北京银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资、资产支持证券投资和同业存单的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	67,459,000.00
合计	67,459,000.00

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日
AAA	760,883,500.00
AAA 以下	-
未评级	1,142,847,000.00

合计	1,903,730,500.00
----	------------------

注：以上未评级的债券投资中包括国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。封闭期内，本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。开放期内，本基金的流动性风险还来自于基金份额持有人可要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2018 年 12 月 31 日，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持



有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,606,040.28	-	-	-	1,606,040.28
交易性金融资产	198,502,000.00	1,772,687,500.00	-	-	1,971,189,500.00
买入返售金融资产	130,000,395.00	-	-	-	130,000,395.00
应收利息	-	-	-	39,882,420.59	39,882,420.59
资产总计	330,108,435.28	1,772,687,500.00	-	39,882,420.59	2,142,678,355.87
负债					
卖出回购金融资产款	595,288,747.06	-	-	-	595,288,747.06
应付管理人报酬	-	-	-	392,067.62	392,067.62
应付托管费	-	-	-	130,689.21	130,689.21
应付交易费用	-	-	-	30,755.09	30,755.09
应付利息	-	-	-	1,082,413.45	1,082,413.45
应交税费	-	-	-	27,233.30	27,233.30
其他负债	-	-	-	240,000.00	240,000.00
负债总计	595,288,747.06	-	-	1,903,158.67	597,191,905.73
利率敏感度缺口	-265,180,311.78	1,772,687,500.00	-	-37,979,261.92	1,545,486,450.14

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	13,370,000.00	-
	市场利率上升 25 个基点	-13,220,000.00	-

### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。在封闭期内，本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，在每个开放期的前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，本基金不受上述比例限制。在开放期内，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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### **7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 1,971,189,500.00 元，无属于第一或第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,971,189,500.00	92.00
	其中：债券	1,971,189,500.00	92.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	130,000,395.00	6.07
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,606,040.28	0.07
8	其他各项资产	39,882,420.59	1.86
9	合计	2,142,678,355.87	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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。

#### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金报告期末未持有股票投资。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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

本基金本报告期内未持有股票投资。

#### 8.4.2 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

本基金本报告期内未持有股票投资。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票投资。

## 8.5 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	1,852,895,500.00	119.89
	其中：政策性金融债	1,142,847,000.00	73.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	50,835,000.00	3.29
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	67,459,000.00	4.36
9	其他	-	-
10	合计	1,971,189,500.00	127.54

## 8.6 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	180211	18 国开 11	4,900,000	496,517,000.00	32.13
2	180204	18 国开 04	2,500,000	261,800,000.00	16.94
3	180212	18 国开 12	1,600,000	161,760,000.00	10.47
4	180208	18 国开 08	1,400,000	142,562,000.00	9.22
5	1828005	18 浙商银行 01	1,000,000	101,690,000.00	6.58

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

#### 8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

#### 8.11.3 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	39,882,420.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,882,420.59

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期内未持有股票投资。

#### 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2	752, 597, 301. 33	1, 505, 194, 602. 65	100. 00%	0. 00	0. 00%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0. 00	0. 0000%

### 9.3 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10, 000, 000. 00	0. 66	10, 000, 000. 00	0. 66	三年
基金管理人高级管理人员	0. 00	0. 00	0. 00	0. 00	-
基金经理等人员	0. 00	0. 00	0. 00	0. 00	-
基金管理人股东	0. 00	0. 00	0. 00	0. 00	-
其他	0. 00	0. 00	0. 00	0. 00	-
合计	10, 000, 000. 00	0. 66	10, 000, 000. 00	0. 66	-



## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年3月19日）基金份额总额	1,009,999,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	495,195,602.65
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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	1,505,194,602.65

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

### 11.2 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

1、本公司于2018年4月28日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，张萍女士因个人健康原因辞去公司督察长职务，由公司总经理刘建先生于4月28日起代为履行公司督察长职务。

2、本公司于2018年9月27日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，聘任刘晓玲女士为公司副总经理。

3、本公司于2018年11月10日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，聘任聂志刚先生为公司督察长。

4、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为人民币90,000.00元，该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为1年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、本基金托管人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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告》	《中国证券报》、公司网站	2018 年 7 月 25 日
2	《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金分红	《中国证券报》、公司网站	2018 年 10 月 24 日

	公告》		
--	-----	--	--

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20180316-20181231	0.00	1,495,194,602.65	0.00	1,495,194,602.65	99.34%
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。							

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于 2018 年 12 月 22 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于股权变更的公告》，原公司中方股东北方国际信托股份有限公司将所持有的泰达宏利基金管理有限公司全部 51%股权转让给天津市泰达国际控股（集团）有限公司。此次股权转让完成后，公司的注册资本保持不变，仍为人民币 1.8 亿元。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《证券日报》）或登录本基金管理人互联网网址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达宏利基金管理有限公司：客服服务中心电话：400-698-8888（免长话费）或 010-66555662。

泰达宏利基金管理有限公司

2019年3月27日