

重要提示

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。基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前请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。本报告期为2019年4月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况表，包含项目名称、基金简称、场内简称、基金代码、基金运作方式、基金合同生效日、报告期末基金份额总额、投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金管理人、基金托管人。

主要财务指标表，包含主要财务指标、报告期末（2019-06-30）的数值、单位：人民币元。

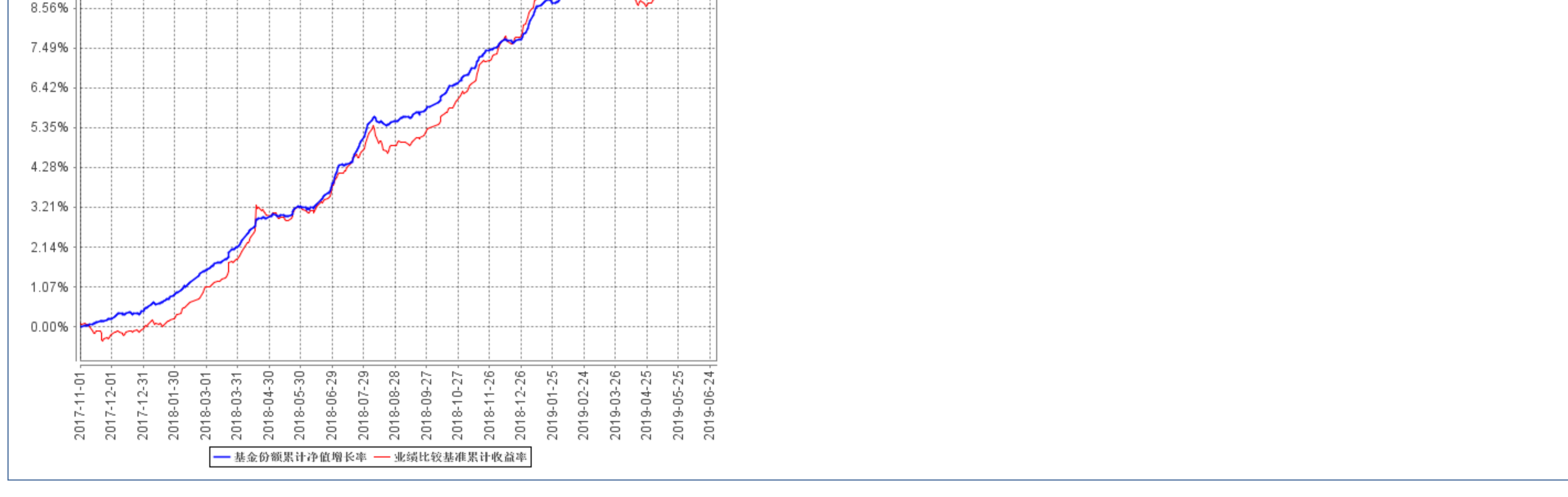
注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的净额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

基金净值表现

本报告期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

基金净值表现对比表，包含阶段、净值增长率、净值增长率标准差、业绩比较基准收益率、业绩比较基准收益率标准差、Q-Q、Q-Q²。

自基金合同生效以来基金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：1、本基金基金合同于2017年11月01日生效。2、按照本基金的基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束本基金各项资产配置符合基金合同约定。

其他指标

其他指标表，包含其他指标、报告期末（2019-06-30）的数值、单位：人民币元。

基金经理（或基金经理小组）简介

基金经理简介表，包含姓名、职务、任本基金的基金经理期限、证券从业年限、说明。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券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为公司相关公告中披露的日期。

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。

公平交易专项说明

本基金管理人公平对待了管理的所有基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过系统和人工等方式在各环节严格控制公平交易行为。在投资管理活动中，各投资组合按投资管理流程和独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

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。报告期内，没有出现本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价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情况。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年二季度，国内宏观经济平稳运行，债市区间震荡，房地产投资依然保持韧性，消费略有回升，制造业投资和基建投资低位运行，中美贸易摩擦加剧使进出口显著下滑，物价方面，能源品种持续产能过剩导致国内价格持续上涨，5月CPI上行2.7%，PPI则在低位的企稳反弹。债券市场方面，利率区间震荡，总体小幅上行，4月份由于三月份金融数据超预期，风险偏好持续提升的影响，利率明显上行；随后，海外利率下行和中美摩擦升级两个因素使得国内债券利率缓慢下行；6月市场多交易，资金面较为宽松，但财政政策发力下的市场预期仍利率进一步上行。二季度来看，10国债上行16bp，10国债上行3bp，交易盘是二季度债券市场的主力。固收投资方面，本基金二季度利率上行过程中加大了中长期信用债配置，显著提高了组合的持有收益率。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达安悦纯债基金份额净值为1.0668元，本报告期基金份额净值增长率为76.17%，同期业绩比较基准增长率为46.60%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

报告期末基金资产组合情况表，包含序号、项目、金额（元）、占基金总资产的比例（%）。

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合表，包含序号、行业类别、公允价值（元）、占基金总资产比例（%）。

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

报告期末按行业分类的港股通股票投资组合

报告期末按行业分类的港股通股票投资组合表，包含序号、行业类别、公允价值（元）、占基金总资产比例（%）。

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

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

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表，包含序号、股票代码、股票名称、数量（股）、公允价值（元）、占基金资产净值比例（%）。

注：本基金本报告期末未持有股票。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末按债券品种分类的债券投资组合表，包含序号、债券品种、公允价值（元）、占基金资产净值比例（%）。

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

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表，包含序号、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（%）。

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

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表，包含序号、证券代码、证券名称、数量（份）、公允价值（元）、占基金资产净值比例（%）。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细表，包含代码、名称、持仓量（买/卖）、合约市值（元）、公允价值变动（元）、风险指标说明。

注：本基金报告期内未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细表，包含代码、名称、持仓量（买/卖）、合约市值（元）、公允价值变动（元）、风险指标说明。

注：本基金报告期内未投资国债期货。

报告期末本基金投资的期权交易情况说明

无。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细表，包含代码、名称、持仓量（买/卖）、合约市值（元）、公允价值变动（元）、风险指标说明。

注：本基金报告期内未投资股指期货。

基金管理人持有基金份额变动情况

基金管理人持有基金份额变动情况表，包含项目、基金份额、单位：份。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人运用固有资金投资本基金情况表，包含序号、交易日期、交易份额（份）、交易金额（元）、适用费率。

注：报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

报告期内基金发起资金运用情况

报告期内基金发起资金运用情况表，包含项目、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。

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

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况表，包含投资者类别、序号、持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间、期初份额、申购份额、赎回份额、报告期末持有基金份额、份额占比。

注：产品持有风险。当基金出现单一持有基金份额比例达到或超过20%时，基金管理人将审慎确认申购与大额赎回，投资者将面临管理人拒绝或暂停申购、赎回限制以及赎回支付赎回款的时间、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金净值造成一定影响等持有风险。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰达安悦纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的文件；(二) 《泰达安悦纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；(三) 《泰达安悦纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；(四) 《泰达安悦纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》。

存放地点

基金管理人、基金托管人的住所。

查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《上海证券报》）或泰达基金管理人互联网网址（http://www.tafunds.com.cn）查阅。