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

2019 半年度报告摘要

2019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：交通银行股份有限公司
送出日期：2019年8月24日

§1 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22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2019年1月1日起至2019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	泰达宏利交利债券	
基金主代码	005315	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年12月27日	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,827,720,615.42份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	泰达宏利交利债券A	泰达宏利交利债券C
下属分级基金的交易代码：	005315	005316
报告期末下属分级基金的份额总额	4,827,720,615.42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	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，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 2.开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动
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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	聂志刚	陆志俊
	联系电话	010-66577678	95559
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-698-8888	95559
传真		010-66577666	021-62701216

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	泰达宏利交利债券A	泰达宏利交利债券C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 – 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 – 2019年6月30日)
本期已实现收益	87,115,041.11	–
本期利润	93,039,107.04	–
加权平均基金份额本期利润	0.0199	–
本期基金份额净值增长率	2.10%	–
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0326	–
期末基金资产净值	5,059,239,150.36	–
期末基金份额净值	1.0480	–

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、截止至2019年6月30日本基金C级份额为零。

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

泰达宏利交利债券A

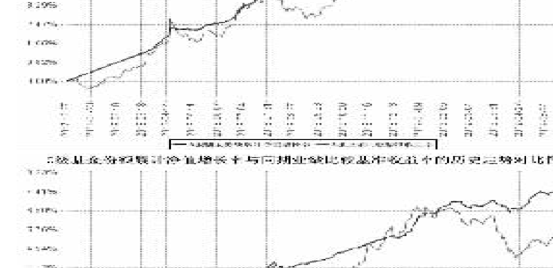
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去一个月	0.49%	0.03%	0.47%	0.07%	0.02%	–0.04%
过去三个月	0.81%	0.05%	–0.53%	0.11%	1.34%	–0.06%
过去六个月	2.10%	0.05%	–0.37%	0.10%	2.47%	–0.05%
过去一年	4.80%	0.04%	2.70%	0.10%	2.10%	–0.06%
自基金合同生效起至今	7.90%	0.04%	5.82%	0.11%	2.08%	–0.07%

泰达宏利交利债券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	0.49%	0.03%	0.47%	0.07%	0.02%	–0.04%
过去三个月	0.81%	0.05%	–0.53%	0.11%	1.34%	–0.06%
过去六个月	2.10%	0.05%	–0.37%	0.10%	2.47%	–0.05%
过去一年	4.80%	0.04%	2.70%	0.10%	2.10%	–0.06%
自基金合同生效起至今	7.90%	0.04%	5.82%	0.11%	2.08%	–0.07%

注：本基金业绩比较基准：中债总指数(全价)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要求。

§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、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创业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、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、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）、泰达宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、泰达宏利年年添利定期开放债券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		
傅浩	本基金基金经理	2017年12月27日	–	12	华中科技大学理学硕士；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，担任投资经理；2016年11月加入泰达宏利基金管理有限公司，先后担任固定收益部基金经理助理、基金经理等职；具备12年证券投资管理经验，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。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

上半年，市场经历了巨幅波动，先是定向降准刺激市场向10年国债3%底线发起冲击。但是一季度经济数据的逆转性变化，又使得市场走出了一波猛烈的调整。随着社融等经济数据证伪已经开始，经济数据疲软。美欧央行整体释放强烈鸽派信号使得新兴市场国家流动性困局得到了缓解，掣肘我国债市的外部压制因素又为我们打开了想象空间。

本基金去年年底开始逐步降低仓位和久期，使得我们受到的了较小的冲击，一季度的净值波动变化较小，同时在二季度开始拉长久期，增加杠杆的组合仓位构成，但是基于不会重启大牛市判断下，我们选择了市场来回震荡中定价相对错误的5年期品种，展开新的组合配置。在上述的综合因素下获得较好的回报，还获得了流动性释放下的定价纠错产生的价差收益。

包商银行的事件冲击，使得我们开始清醒地认识到打破刚兑以及信用利差的重新定价已经逐步深化到市场深处。基于此产生的新一轮债券重新定价过程，其中包括我们一直认可的高等级的信用债都将进行一轮新的排序定价。

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交利债券A基金份额净值为1.0480元，本报告期基金份额净值增长率为2.10%；截至本报告期末泰达宏利交利债券C基金份额净值为1.0480元，本报告期基金份额净值增长率为2.10%；同期业绩比较基准收益率为–0.37%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，债券市场，我们认为经济阶段处于"支柱产业结构调整期"的观点没有变化，债券市场逆转也是不太能实现的形态。目前市场正在进入到一种混沌的局面，我们将寻找有定价误差的中久期品种骑乘收益机会，达到整个组合防守与进攻兼备。为进一步规避信用风险，组合将持仓进一步拉升到AAA级信用债及利率债为主的仓位配置状态。这一持仓调整，除为了规避信用风险外，还为避开新的信用定价过程产生的损益。

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情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

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，基金托管人在泰达宏利交利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，泰达宏利基金管理有限公司在泰达宏利交利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

本报告期内，由泰达宏利基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关泰达宏利交利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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：泰达宏利交利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：		
银行存款	443,562.14	2,087,781.53
结算备付金	33,503,499.92	24,525,863.51
存出保证金	165,791.15	49,320.02
交易性金融资产	6,123,882,000.00	4,269,573,000.00
其中：股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	6,123,882,000.00	4,269,573,000.00
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	–	60,000,410.00
应收证券清算款	–	–
应收利息	91,795,703.14	61,955,317.07
应收股利	–	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	6,249,790,556.35	4,418,191,692.13
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	1,187,898,891.15	949,748,975.37
应付证券清算款	113,284.30	148,760.33
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	1,243,503.40	881,316.46
应付托管费	414,501.14	293,772.14
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	46,225.00	27,156.64
应交税费	381,832.76	279,423.37
应付利息	349,708.85	302,244.50
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	103,459.39	309,000.00
负债合计	1,190,551,405.99	951,990,648.81
所有者权益：		
实收基金	4,827,720,615.42	3,376,904,288.89
未分配利润	231,518,534.94	89,296,754.43
所有者权益合计	5,059,239,150.36	3,466,201,043.32
负债和所有者权益总计	6,249,790,556.35	4,418,191,692.13

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0480元，基金份额总额4,827,720,615.42份。

6.2利润表

会计主体：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

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	120,082,887.57	75,282,524.86
1.利息收入	103,859,943.58	56,969,539.93
其中：存款利息收入	352,150.81	29,761,341.49
债券利息收入	103,483,901.54	26,166,914.41
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	23,891.23	1,041,284.03
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以"–"填列）	10,298,878.06	928,314.43
其中：股票投资收益	–	–
基金投资收益	–	–
债券投资收益	10,298,878.06	928,314.43
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）	5,924,065.93	17,384,670.50
4.汇兑收益（损失以"–"号填列）	–	–
5.其他收入（损失以"–"号填列）	–	–
减：二、费用	27,043,780.53	8,071,662.32
1.管理人报酬	7,235,773.23	3,489,757.65
2.托管费	2,411,924.39	1,163,252.54
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	26,500.16	16,900.00
5.利息支出	16,967,290.73	3,167,903.38
其中：卖出回购金融资产支出	16,967,290.73	3,167,903.38
6.税金及附加	272,584.71	75,793.98
7.其他费用	129,707.31	158,054.77
三、利润总额（亏损总额以"–"号填列）	93,039,107.04	67,210,862.54
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以"–"号填列）	93,039,107.04	67,210,862.54

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	3,376,904,288.89	89,296,754.43	3,466,201,043.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	93,039,107.04	93,039,107.04
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）	1,450,816,326.53	49,182,673.47	1,499,999,000.00
其中：1.基金申购款	1,450,816,326.53	49,182,673.47	1,499,999,000.00
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）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	4,827,720,615.42	231,518,534.94	5,059,239,150.36
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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）	2,209,999,000.00	1,398,233.71	2,211,397,233.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	67,210,862.54	67,210,862.54
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）	197,257,125.95	2,741,874.05	199,999,000.00
其中：1.基金申购款	197,257,125.95	2,741,874.05	199,999,000.00
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）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	2,407,256,125.95	71,350,970.30	2,478,607,096.25

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：

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

6.4报表附注

6.4.1基金基本情况

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(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[2017]1954号《关于准予泰达宏利交利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《泰达宏利交利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2,209,999,000.00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(2017)第1006号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于2017年12月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,209,999,000.00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，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")。

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《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基金合同》和《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招募说明书》并报中国证监会备案，本基金自募集期起根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中，在投资人认购、申购时收取认购、申购费，但不再从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购、申购时不收取认购、申购费，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，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，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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%，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。

本基金以定期开放方式运作，即本基金以封闭期和开放期相结合的方式运行。基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于2亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。基金合同生效三年后继续存续的，基金存续期内，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会审议。

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》、《泰达宏利交利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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年上半年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2019年6月30日的财务状况以及2019年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4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。

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[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。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	443,562.14
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：	443,562.14

6.4.7.2交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019年6月30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	866,148,543.31	864,454,000.00	–1,694,543.31
	银行间市场	5,218,800,313.94	5,259,428,000.00	40,627,686.06
	合计	6,084,948,857.25	6,123,882,000.00	38,933,142.75
资产支持证券		–	–	–
基金		–	–	–
其他		–	–	–
合计		6,084,948,857.25	6,123,882,000.00	38,933,142.75

6.4.7.3衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产和负债。

6.4.7.4买入返售金融资产

6.4.7.4.1各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产无余额。

6.4.7.4.2期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	269.69
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	13,568.94
应收债券利息	91,781,797.37
应收资产支持证券利息	–
应收买入返售证券利息	–
应收申购款利息	–
应收黄金合约拆借孳息	–
其他	67.14
合计	91,795,703.14

6.4.7.6其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	–
银行间市场应付交易费用	46,225.00
合计	46,225.00

6.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	–
应付赎回费	–
预提费用	103,459.39
合计	103,459.39

6.4.7.9实收基金

金额单位：人民币元

泰达宏利交利债券A

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,376,904,288.89	3,376,904,288.89
本期申购	1,450,816,326.53	1,450,816,326.53
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	4,827,720,615.42	4,827,720,615.42

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。截止至2019年6月30日本基金C类份额为零。

6.4.7.10未分配利润

单位：人民币元

泰达宏利交利债券A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	47,705,621.54	41,591,132.89	89,296,754.43
本期利润	87,115,041.11	5,924,065.93	93,039,107.04
本期基金份额交易产生的变动数	22,515,288.15	26,667,385.32	49,182,673.47
其中：基金申购款	22,515,288.15	26,667,385.32	49,182,673.47
基金赎回款	–	–	–
本期已分配利润	–	–	–
本期末	157,335,950.80	74,182,584.14	231,518,534.94

注：截止至2019年6月30日本基金C类无未分配利润。

6.4.7.11存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	59,584.96
定期存款利息收入	–
其他存款利息收入	–
结算备付金利息收入	291,521.65
其他	1,044.20
合计	352,150.81

6.4.7.12股票投资收益

6.4.7.12.1股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无买卖股票差价收入。

6.4.7.13债券投资收益

6.4.7.13.1债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	10,298,878.06
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	10,298,878.06

6.4.7.13.2债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,617,700,406.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,549,754,645.69
减：应收利息总额	57,646,882.25
买卖债券差价收入	10,298,878.06

6.4.7.13.3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。

6.4.7.13.4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。

6.4.7.13.5资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14贵金属投资收益

6.4.7.14.1贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

6.4.7.14.4贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

6.4.7.15衍生工具收益

6.4.7.15.1衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益–买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益–其他投资收益。

6.4.7.16股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	5,924,065.93
——股票投资	–
——债券投资	5,924,065.93
——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	5,924,065.93

6.4.7.18其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	6,975.16
银行间市场交易费用	19,525.00
交易基金产生的费用	–
其中：申购费	–
赎回费	–
合计	26,500.16

6.4.7.20其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	58,828.41
其他	600.00
账户维护费	18,000.00
银行费用	7,647.92
合计	129,707.31

6.4.8关联方关系

6.4.8.1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。

6.4.8.2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
交通银行股份有限公司("交通银行")	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。

6.4.9本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.4权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.9.2关联方报酬

6.4.9.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,235,773.23	3,489,757.65
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。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

6.4.9.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,411,924.39	1,163,252.54

注：支付基金托管人交通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。

6.4.9.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年可比期间均无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.9.4各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	泰达宏利交利债券A	泰达宏利交利债券C
基金合同生效日（2017年12月27日）持有的基金份额	10,000,000.00	0.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2071%	0.0000%
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	泰达宏利交利债券A	泰达宏利交利债券C
基金合同生效日（2017年12月27日）持有的基金份额	10,000,000.00	0.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.4154%	0.0000%

注：本基金的管理人在本报告期内均未运用固有资金新增投资本基金。

6.4.9.4.2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

泰达宏利交利债券A

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
交通银行股份有限公司	4,817,720,615.42	99.7929%	3,366,904,288.89	99.7039%

注：1. 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；

2. 本基金的关联方在本报告期内未运用固有资金投资C类基金份额。

6.4.9.5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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	443,562.14	59,584.96	1,856,711.73	28,563.73

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按约定利率计息。

6.4.9.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.9.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.10期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1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。

6.4.10.2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。

6.4.10.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019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605,898,891.15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
120226	12国开26	2019年7月1日	97.09	4,000,000	388,360,000.00
110207	11国开07	2019年7月1日	98.54	2,420,000	238,466,800.00
合计				6,420,000	626,826,800.00

6.4.10.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额582,000,000.00元，于2019年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.11有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	基金投资	–	–
3	固定收益投资	6,123,882,000.00	97.99
	其中：债券	6,123,882,000.00	97.99
	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	–	–
	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	33,947,062.06	0.54
8	其他各项资产	91,961,494.29	1.47
9	合计	6,249,790,556.35	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初基金资产净值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。

7.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值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。

7.4.3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。

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	1,515,001,000.00	29.95
	其中：政策性金融债	973,414,000.00	19.24
4	企业债券	864,454,000.00	17.09
5	企业短期融资券	250,380,000.00	4.95
6	中期票据	3,494,047,000.00	69.06
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	6,123,882,000.00	121.04

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	120226	12国开26	4,000,000	388,360,000.00	7.68
2	101900066	19招商局MTN001	3,600,000	359,460,000.00	7.11
3	101551081	15铁道MTN002	3,000,000	302,340,000.00	5.98
4	1182082	11中铁股MTN1	3,000,000	300,120,000.00	5.93
5	110207	11国开07	3,000,000	295,620,000.00	5.84

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.11.2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。

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	165,791.15
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	91,795,703.14
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	91,961,494.29

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

本基金本报告期内未持有股票投资。

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
泰达宏利交利债券A	2	2,413,860,307.71	4,827,720,615.42	100.00%	0.00	0.00%
泰达宏利交利债券C	0	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	2	2,413,860,307.71	4,827,720,615.42	100.00%	0.00	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	泰达宏利交利债券A	0.00	0.0000%
	泰达宏利交利债券C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	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	泰达宏利交利债券A	0
	泰达宏利交利债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利交利债券A	0
	泰达宏利交利债券C	0
	合计	0

8.4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	0.21	10,000,000.00	0.21	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	0.21	10,000,000.00	0.21	–

§9开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利交利债券A	泰达宏利交利债券C
基金合同生效日（2017年12月27日）基金份额总额	2,209,999,000.00	–
本报告期期初基金份额总额	3,376,904,288.89	–
本报告期基金总申购份额	1,450,816,326.53	–
减：本报告期基金总赎回份额	–	–
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"–"填列）	–	–
本报告期期末基金份额总额	4,827,720,615.42	–

§10重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有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

1、本公司于2019年1月19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》，王彦杰先生不再担任公司副总经理。 2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管人、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.本报告期内，中国证券监督管理委员会北京监管局对我司进行了常规全面现场检查，就公司未能建立完善的内控监控体系，提出了整改意见并下达了行政监管措施函，公司对此高度重视，立即制定整改计划和整改方案，认真进行整改，排除业务中存在的风险隐患，逐一落实各项整改要求，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力。公司已按照要求于2019年4月完成整改工作，并通过了中国证券监督管理委员会北京监管局的检查验收。 2.本报告期内，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	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	
湘财证券	2	–	–	–	–	–

注：(一)2019年上半年本基金交易单元无变更。

（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，使用其交易单元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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
湘财证券	1,615,592,112.35	100.00%	49,532,600,000.00	100.00%	–	–

§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	20190101~20190630	3,366,904,288.89	1,450,816,326.53	0.00	4,817,720,615.42	99.79%
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。

泰达宏利基金管理有限公司

2019年8月24日