

泰达宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF) (原泰达宏利聚利分级债券型证 券投资基金) 2016 年第 2 季度报告

2016 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 7 月 19 日

§1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 7 月 15 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。

泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）由原泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金转型而来。根据基金合同的有关规定，泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金于 2016 年 5 月 13 日转换成泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）。原泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金本报告期自 2016 年 4 月 1 日至 2016 年 5 月 13 日止，泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）本报告期自 2016 年 5 月 14 日至 2016 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	泰达宏利聚利债券（LOF）
场内简称	泰达聚利
交易代码	162215
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2011 年 5 月 13 日
报告期末基金份额总额	1,384,741,875.86 份
投资目标	本基金主要投资于固定收益证券，在合理控制信用风险的基础上，通过积极主动的管理，力求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	从利率、信用等角度深入挖掘信用债市场投资机会，在有效控制流动性风险及信用风险等风险的前提下，力争创造稳健收益。

业绩比较基准	中债企业债总全价指数收益率×90%+中债国债全价指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为较低风险品种，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。
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

转型前：

基金简称	泰达宏利聚利分级债券	
交易代码	162215	
基金运作方式	契约型封闭式	
基金合同生效日	2011年5月13日	
报告期末基金份额总额	1,582,104,870.50份	
投资目标	本基金主要投资于固定收益证券，在合理控制信用风险的基础上，通过积极主动的管理，力求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	从利率、信用等角度深入挖掘信用债市场投资机会，在有效控制流动性风险及信用风险等风险的前提下，力争创造稳健收益。	
业绩比较基准	中债企业债总全价指数收益率×90%+中债国债全价指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为较低风险品种，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。	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	聚利 A	聚利 B
下属分级基金的交易代码	150034	150035
报告期末下属分级基金的份额总额	1,107,473,410.47份	474,631,460.03份
下属分级基金的风险收益特征	聚利 A 份额表现出低风险、收益相对稳定的特征	聚利 B 份额表现出较高风险、收益相对较高的特征

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年5月14日—2016年6月30日）
1. 本期已实现收益	9,810,862.80
2. 本期利润	13,317,281.00

3. 加权平均基金份额本期利润	0.0070
4. 期末基金资产净值	1,396,896,135.11
5. 期末基金份额净值	1.009

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. 所列数据截止到2016年6月30日。

3.1 主要财务指标（转型前）

主要财务指标	报告期（2016年4月1日—2016年5月13日）
1. 本期已实现收益	6,959,628.74
2. 本期利润	-12,880,526.24
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0081
4. 期末基金资产净值	2,406,935,014.91
5. 期末基金份额净值	1.521

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. 所列数据截止到2016年5月13日。

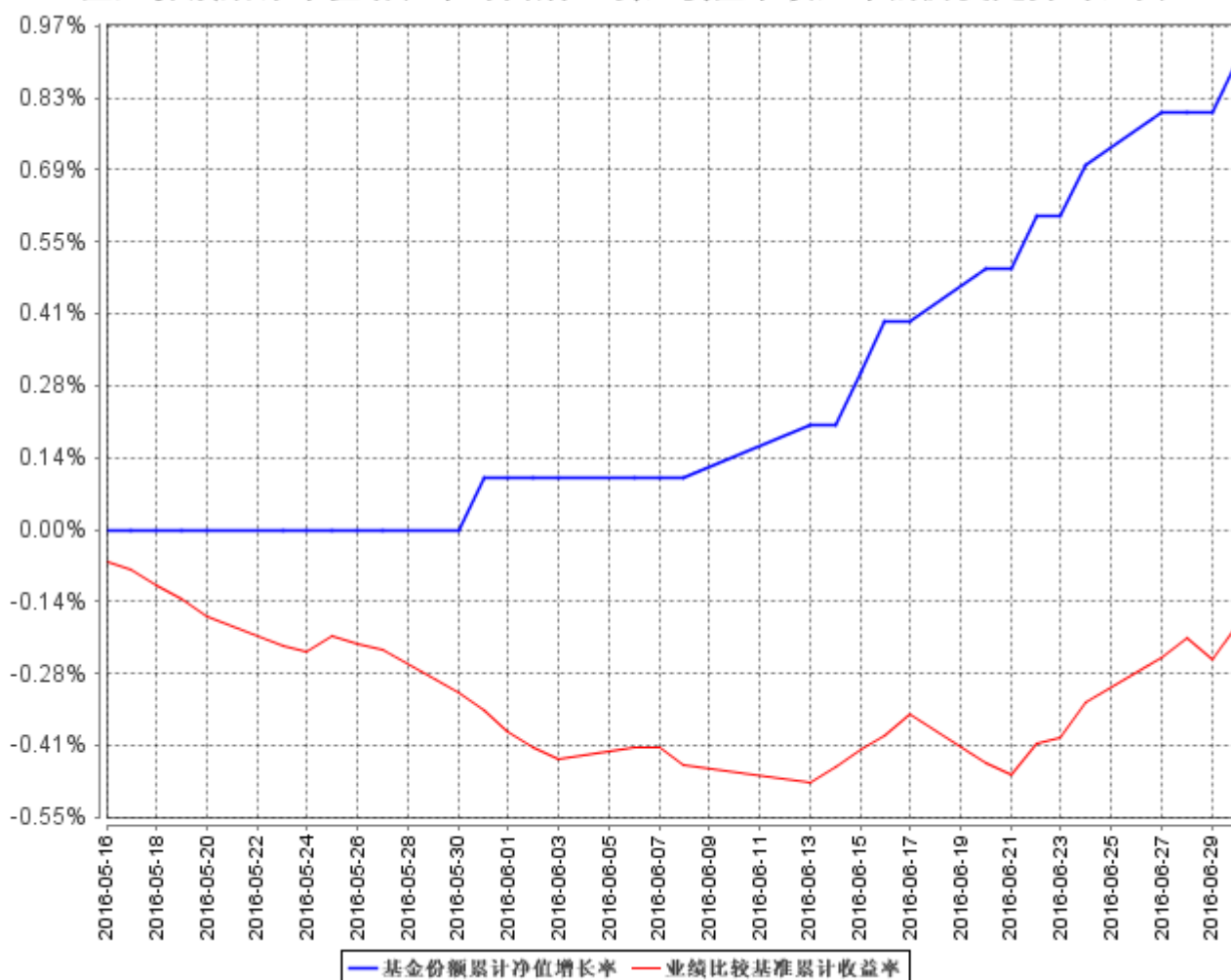
3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期（2016年5月14日—2016年6月30日）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	净值增长率 ①	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
2016年 5月14日至 2016年 6月30日	0.90%	0.05%	-0.18%	0.04%	1.08%	0.01%

3.2.2 自基金转型以来（2016年5月14日－2016年6月30日）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

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



本基金在建仓期结束时及报告期末，各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

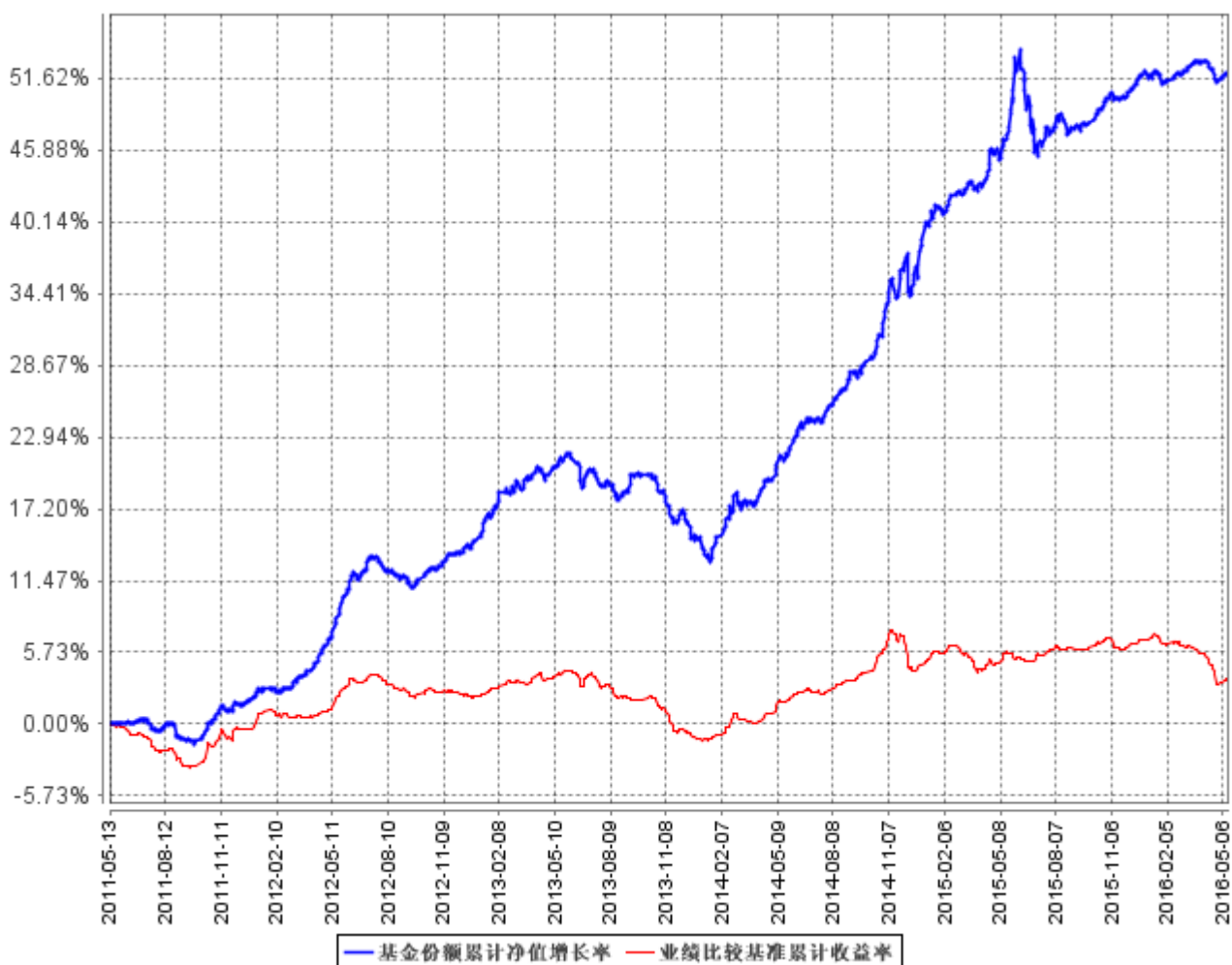
3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期（2016年4月1日－2016年5月13日）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	净值增长率①	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
2016年4月1日至2016年5月13日	-0.50%	0.09%	-1.84%	0.14%	1.34%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来（2011年5月13日－2016年5月13日）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



本基金在建仓期结束时及报告期末，各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
卓若伟	固定收益部总监、本基金经理	2015年6月11日	-	12	经济学硕士；2004年7月至2006年9月任职于厦门市商业银行资金营运部，从事债券交易与研究工作；2006年10月至2009年5月就职于建信基金管理有限公司专户投资部任投资经理；2009年5月起就职于

					诺安基金管理有限公司，任基金经理助理，2009年9月至2011年12月任诺安增利债券型证券投资基金基金经理；2011年12月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾担任固定收益部副总经理、总经理，现任固定收益部总监；具备10年基金从业经验，12年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
丁宇佳	本基金基金经理	2015年6月11日	-	8	丁宇佳女士毕业于中央财经大学，理学学士；2008年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任交易部交易员，负责债券交易工作；2013年9月起先后担任固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理；具备8年基金从业经验，8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 公平交易专项说明

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，没有发生利益输送、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 2 次。2 次涉及的投资组合一方均为按照量化策略进行投资，虽然买卖股票量少，但由于个股流动性较差，交易量小，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%，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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年二季度，全球经济延续了低速复苏态势，美国二季度就业和消费数据稳健，英国脱欧事件延缓了美国加息的步伐，稳定的国内经济继续推动 CPI 缓慢上行，实体经济表现良好，日本继续维持负利率和量化宽松的货币政策，但升值压力使出口抗压，英国脱欧事件给欧洲慢复苏蒙上了阴影，新兴经济体基本面仍不乐观。

国内经济高频数据出现一定程度改善，经济呈弱企稳迹象。二季度工业需求前景仍没有大幅改善，工业增加值增速较一季度没有太大改观，但发电数据有所改善，PPI 降幅收敛，第三产业发展平稳，服务业 PMI 向好。固定资产投资增速出现下滑，房地产销售火爆，但对制造业和建筑业的拉动存在一定滞后，基建继续承压。内需仍维持低迷，外需在欧洲金融体系不稳定的背景下存在不确定性。蔬菜价格下跌，猪肉价格涨幅缩小，居民消费价格指数 CPI 同比增速处于下行通道。表外融资低迷，贷款有所恢复，但 M2 和社融数据受同比基数偏高的影响可能继续回落。

在供给侧改革与稳增长背景下，央行继续采取了 MLF、PSL 和公开市场逆回购操作日常化等操作来提供流动性，以期降低社会融资成本、稳定资金面和提振经济，短期内央行中性偏宽松的货币政策不会改变。二季度人民币汇率继续面临贬值压力，但外汇储备下降幅度很小。MPA 的二次实施未给季末资金面以太大扰动，利率中枢在二季度维持相对稳定。

债券市场呈现慢牛格局，债市收益率维持震荡，二季度以来，债券市场情绪受信用事件和英国脱欧事件的影响，波动较大，收益率曲线趋于平坦。

报告期内，我们认为，基本面对债市仍然有利，但收益率存在一定波动风险，同时信用风险事件频发，违约主体的性质和行业越发分散化，我们适当降低了债券杠杆并维持中短久期，精选信用债，严防信用风险事件。从资产轮动的角度考虑，我们维持了较低的转债仓位，较高的利率债仓位，报告期内获得了相对满意的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

聚利（转型后）

截止报告期末，本基金份额净值为 1.009 元，本报告期份额净值增长率为 0.90%，同期业绩比较基准增长率为-0.18%。

聚利（转型前）

截止 2016 年 5 月 13 日，本基金份额净值为 1.521 元，本报告期份额净值增长率为-0.50%，同期业绩比较基准增长率为-1.84%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	7,540,411.15	0.44
	其中：股票	7,540,411.15	0.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,667,887,067.80	97.75
	其中：债券	1,667,887,067.80	97.75
	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	3,846,472.51	0.23
8	其他资产	27,065,907.79	1.59
9	合计	1,706,339,859.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	4,324,320.00	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,195,171.15	0.23
E	建筑业	20,920.00	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,540,411.15	0.54

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

5.3 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

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（%）
1	002521	齐峰新材	378,000	4,324,320.00	0.31
2	600023	浙能电力	627,735	3,195,171.15	0.23
3	601611	中国核建	1,000	20,920.00	0.00

注：以上为本基金本报告期末持有的全部股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	503,995,000.00	36.08
	其中：政策性金融债	503,995,000.00	36.08
4	企业债券	600,691,167.80	43.00

5	企业短期融资券	346,558,600.00	24.81
6	中期票据	214,570,000.00	15.36
7	可转债（可交换债）	2,072,300.00	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,667,887,067.80	119.40

5.5 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

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（%）
1	160402	16农发02	2,000,000	199,440,000.00	14.28
2	150314	15进出14	1,000,000	103,930,000.00	7.44
3	011699696	16新兴际华SCP003	1,000,000	100,160,000.00	7.17
4	160414	16农发14	1,000,000	100,020,000.00	7.16
5	011698014	16中车SCP002	1,000,000	99,970,000.00	7.16

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

在本报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	42,170.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,987,741.71
5	应收申购款	6,855.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	29,140.31
8	其他	-
9	合计	27,065,907.79

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601611	中国核建	20,920.00	0.00	临时停牌

5.11.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	15,832,595.00	0.66
	其中：股票	15,832,595.00	0.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,017,441,989.00	83.78
	其中：债券	2,017,441,989.00	83.78
	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	325,000,762.50	13.50
	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	5,892,470.54	0.24
8	其他资产	43,786,566.24	1.82
9	合计	2,407,954,383.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	23,595.00	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,325,000.00	0.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,484,000.00	0.48
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,832,595.00	0.66

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

5.3 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

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（%）
1	600023	浙能电力	2,200,000	11,484,000.00	0.48
2	002521	齐峰新材	500,000	4,325,000.00	0.18
3	300511	雪榕生物	500	23,595.00	0.00

注：以上为本基金本报告期末持有的全部股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	672,543,000.00	27.94
	其中：政策性金融债	672,543,000.00	27.94
4	企业债券	656,171,785.20	27.26
5	企业短期融资券	271,255,000.00	11.27
6	中期票据	408,863,000.00	16.99
7	可转债（可交换债）	8,609,203.80	0.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,017,441,989.00	83.82

5.5 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

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（%）
1	160402	16农发02	2,000,000	199,060,000.00	8.27
2	150314	15进出14	1,000,000	103,060,000.00	4.28
3	101556040	15中燃投资MTN001	1,000,000	101,180,000.00	4.20

4	041569028	15 昆交产 CP001	1,000,000	100,640,000.00	4.18
5	160414	16 农发 14	1,000,000	100,040,000.00	4.16

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

在本报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	41,081.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	43,745,485.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,786,566.24

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年5月14日）基金份 额总额	2,406,935,014.91
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	25,858.78
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 份额	1,022,218,997.83
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）	-
报告期期末基金份额总额	1,384,741,875.86

注：上述基金合同生效日的基金份额总额为基金转型起始日（2016年5月14日）的基金份额总额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

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。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

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。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于2011年5月13日生效，封闭期为五年（含五年），本基金的封闭期已于2016年5月13日届满。根据基金合同的有关规定，本基金基封闭期届满后满足基金合同约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换成契约型上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）”。聚利A、聚利B的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金（LOF）份额，并办理基金的申购与赎回业务。本基金份额转换为上市开放式基金（LOF）份额后，基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。详情请见基金管理人发布的如下公告：

1. 2016年3月30日发布《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金封闭运作期届满并进行基金份额转换的提示性公告》
2. 2016年5月10日发布《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金之聚利A、聚利B终止上市的

公告》；

3. 2016年5月10日发布《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金封闭运作期届满并进行基金份额转换的公告》；

4. 2016年5月12日发布《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金之聚利A、聚利B终止上市的提示性公告》；

5. 2016年5月12日发布《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金之聚利A、聚利B暂停办理转托管业务的公告》；

6. 2016年5月12日发布《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金封闭期届满转型后基金名称及简称变更的公告》；

7. 2016年5月17日发布《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金份额转换结果的公告》；

8. 2016年5月20日发布《泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)上市交易公告书》。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金托管协议》。

10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录基金管理人互联网网址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2016年7月19日