

# 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 年半年度报告

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

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 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 1 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。

## 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（转型后）.....	5
2.1 基金基本情况（转型前）.....	5
2.2 基金产品说明（转型后）.....	5
2.2 基金产品说明（转型前）.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）.....	7
3.2 基金净值表现（转型后）.....	8
2.2 基金净值表现（转型前）.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	15
<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 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表（转型后）.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b> .....	<b>37</b>
6.1 资产负债表（转型前）.....	37
6.2 利润表.....	38
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	39
6.4 报表附注.....	41
<b>§7 投资组合报告（转型后）</b> .....	<b>59</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	59
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	59

7.3 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 .....	60
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
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 .....	62
7.7 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 .....	62
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 .....	62
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 .....	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
7.12 投资组合报告附注 .....	63
<b>§7 投资组合报告（转型前） .....</b>	<b>64</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	64
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	64
7.3 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 .....	65
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	66
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序号的前五名债券投资明细 .....	66
7.7 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 .....	67
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 .....	67
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 .....	67
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
7.12 投资组合报告附注 .....	67
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>68</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
8.4 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 .....	69
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>69</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>70</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
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 .....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
10.4 基金投资策略的改变 .....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
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 .....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
10.8 其他重大事件 .....	71
<b>§11 备查文件目录 .....</b>	<b>73</b>
11.1 备查文件目录 .....	73
11.2 存放地点 .....	73
11.3 查阅方式 .....	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）
基金简称	泰达宏利聚利债券（LOF）
场内简称	泰达聚利
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	1,384,741,875.86 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016-05-25

注：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 2016 年 5 月 13 日转型而来。

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金	
基金简称	泰达宏利聚利债券	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	1,582,104,870.50 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2011-07-08	
下属分级基金的基金简称：	泰达宏利聚利 A	泰达宏利聚利 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

注：泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金于 2016 年 5 月 13 日终止上市。

### 2.2 基金产品说明（转型后）

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（若有）	中债企业债总全价指数收益率×90%+中债国债总全价指数收益率×10%
风险收益特征（若有）	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。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

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（若有）	中债企业债总全价指数收益率×90%+中债国债总全价指数收益率×10%
风险收益特征（若有）	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。

## 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	王永民
	联系电话	010-66577808	010-66594896
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95566
传真		010-66577666	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		弓劲梅	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.mfcteda.com
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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 5 月 14 日 - 2016 年 6 月 30 日 )	
	转型后	
本期已实现收益	9,810,862.80	
本期利润	13,317,281.00	
加权平均基金份额本期利润	0.0070	
本期加权平均净值利润率	0.70%	
本期基金份额净值增长率	0.90%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )	
期末可供分配利润	480,759,574.30	
期末可供分配基金份额利润	0.3472	
期末基金资产净值	1,396,896,135.11	
期末基金份额净值	1.009	
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )	
基金份额累计净值增长率	0.90%	

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. 所列数据截止到 2016 年 6 月 30 日。

### 3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 5 月 13 日 )	
	转型前	
本期已实现收益	42,323,481.10	
本期利润	-554,633.18	
加权平均基金份额本期利润	-0.0004	
本期加权平均净值利润率	-0.02%	
本期基金份额净值增长率	-0.04%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2016 年 5 月 13 日 )	

期末可供分配利润	821,019,046.15
期末可供分配基金份额利润	0.5189
期末基金资产净值	2,406,935,014.91
期末基金份额净值	1.521
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2016年5月13日）
基金份额累计净值增长率	52.13%

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. 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 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

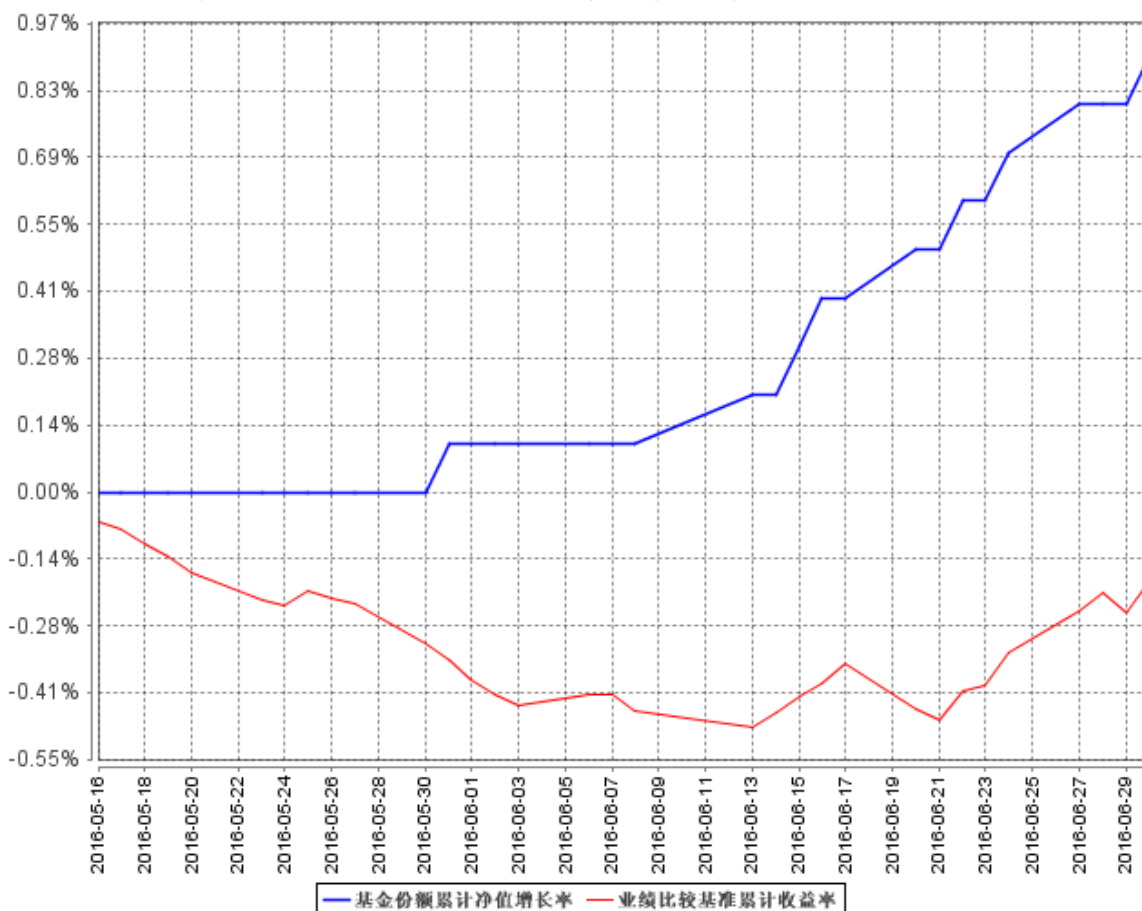
转型后						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016年5月14日-2016年6月30日	0.90%	0.05%	-0.18%	0.04%	1.08%	0.01%

注：本基金的业绩比较基准：中债企业债总全价指数收益率\*90%+中债国债总全价指数收益率\*10%



### 3.2.2 自基金转型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。

## 2.2 基金净值表现（转型前）

### 3.2.3 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

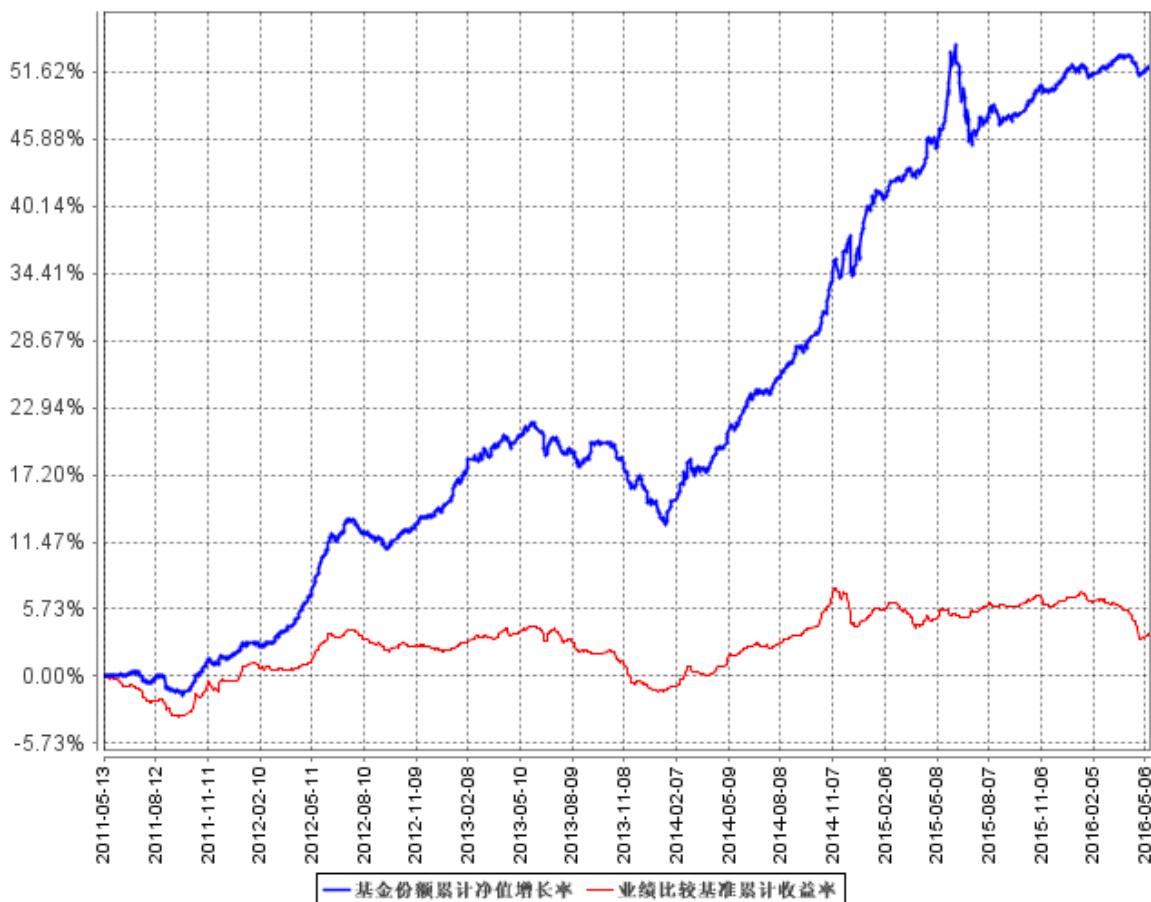
转型前						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2016年5月1日 -2016年5月13日	0.42%	0.04%	0.41%	0.03%	0.01%	0.01%
2016年4月1日 -2016年5月13日	-0.50%	0.09%	-1.84%	0.14%	1.34%	-0.05%
2016年1月1日 -2016年5月13日	-0.04%	0.09%	-2.85%	0.11%	2.81%	-0.02%

月 13 日						
2015 年 7 月 1 日 -2016 年 5 月 13 日	2.59%	0.14%	-1.27%	0.09%	3.86%	0.05%
2013 年 7 月 1 日 -2016 年 5 月 13 日	26.99%	0.23%	-0.01%	0.10%	27.00%	0.13%
自基金合同生效起至 2016 年 5 月 13 日	52.13%	0.20%	3.67%	0.10%	48.46%	0.10%

注：本基金的业绩比较基准：中债企业债总全价指数收益率\*90%+中债国债总全价指数收益率\*10%

### 3.2.4 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。

## § 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在内的三十多只证券投资基金。

#### 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		
卓若伟	本基金基金经理，固定收益部总监	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。
丁字佳	本基金基金经理	2015 年 6 月 11 日	-	8	丁字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 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。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。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处罚的情况。

## 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

2016 年上半年，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，英国退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政策，但升值压力使出口抗压；英国退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，但资本流出压力有所减小。

国内经济高频数据出现一定程度改善，经济呈弱企稳迹象。工业需求前景没有大幅改善，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 保持低位震荡。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。人民币汇率继续面临贬值压力，但外汇储备下降幅度很小。

债券市场整体呈现慢牛格局，4 月信用事件爆发成为收益率全面回调的导火索，信用利差有所扩大。但期限利差一直处于收窄态势，收益率曲线趋平。股票大幅震荡下行同样维持震荡格局，目前呈边际企稳，转债随正股弱势调整，二级市场机会不大。

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。

#### 4.4.2 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-0.04%，同期业绩比较基准增长率为-2.85%。

#### 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 2016 年下半年，欧洲经济仍存在很大不确定性，美元、日元升值会带来人民币被动贬值，中国经济可能继续维持弱企稳，CPI 和 PPI 可能继续上行，但幅度可控。公开市场操作仍然是呵护流动性的主要手段，降准降息操作概率不大。同时由于绝对收益率偏低，机构加杠杆行为严重，事件性冲击导致的资金紧张容易被放大。

目前债券收益率曲线极度平坦，本基金在下半年将维持谨慎的投资策略，并灵活的采取杠杆操作，同时根据各类属资产风险收益特征的横向比较来进行结构性调整。2016 年以来信用违约事件频发，我们将加强信用研究，高度重视信用风险，积极参与网上打新，力求在控制风险的基础上通过积极的主动管理为持有人贡献超额回报。

#### 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运营的副总经理负责，成员包括督察长、投资总监、基金经理及研究部、交易部、固定收益部、监察稽核部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员，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。本公司参与估值流程各方之间没有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。

#### 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

#### 6.1 资产负债表（转型后）

会计主体：泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	771,571.12
结算备付金		3,074,901.39
存出保证金		42,170.12
交易性金融资产	6.4.7.2	1,675,427,478.95
其中：股票投资		7,540,411.15

基金投资		-
债券投资		1,667,887,067.80
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	26,987,741.71
应收股利		-
应收申购款		6,855.65
其他资产	6.4.7.6	29,140.31
资产总计		1,706,339,859.25
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016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	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		307,496,518.50
应付证券清算款		-
应付赎回款		380,884.60
应付管理人报酬		942,342.46
应付托管费		269,240.69
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	62,982.29
应交税费		71,057.38
应付利息		26,507.83
应付利润		-
其他负债	6.4.7.8	194,190.39
负债合计		309,443,724.14
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	910,251,892.65
未分配利润	6.4.7.10	486,644,242.46
所有者权益合计		1,396,896,135.11
负债和所有者权益总计		1,706,339,859.25

注：1. 报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.009 元，基金份额总额 1,384,741,875.86 份。

2. 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 2016 年 5 月 13 日转型而来。本财务报表的实际编制期间为 2016 年 5 月 14 日至 2016 年 6 月 30 日止。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）



本报告期：2016 年 5 月 14 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 5 月 14 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		15,975,833.16
1. 利息收入		16,531,470.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	43,558.79
债券利息收入		16,310,211.56
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		177,700.49
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,275,614.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,701,463.20
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,168,860.47
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	256,988.45
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,506,418.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	213,558.40
<b>减：二、费用</b>		2,658,552.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,753,153.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	500,901.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	28,512.29
5. 利息支出		309,165.27
其中：卖出回购金融资产支出		309,165.27
6. 其他费用	6.4.7.20	66,819.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13,317,281.00
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13,317,281.00

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 5 月 14 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 5 月 14 日至 2016 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)	1,582,104,870.50	824,830,144.41	2,406,935,014.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,317,281.00	13,317,281.00
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)	-671,852,977.85	-351,503,182.95	-1,023,356,160.80
其中：1. 基金申购款	16,997.86	8,965.75	25,963.61
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-671,869,975.71	-351,512,148.70	-1,023,382,124.41
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)	910,251,892.65	486,644,242.46	1,396,896,135.11

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

泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)由泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金(以下简称“泰达宏利聚利债券基金”)转型而来。根据《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,基金合同生效满五年后,满足基金合同约定的存续条件,泰达宏利聚利债券基金无需召开基金份额持有人大会,将自动转换为上市开放式基金(LOF),基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。原泰达宏利聚利债券基金更名为泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定。泰达宏利聚利债券基金于转换前的基金资产净值为2,406,935,014.91元,已于2016年5月13日全部转为本基金的基金资产净值,按照本基金的基金份额净值1.000元折合为2,406,935,014.91份泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金份额,并由本基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》、《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》和《泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)上市交易公告书》，泰达宏利聚利债券基金将基金份额持有人初始有效认购的基金总份额按照 7:3 的比例分离为预期收益与预期风险不同的两种份额类别，即优先类基金份额(基金份额简称“聚利 A”)和进取类基金份额(基金份额简称“聚利 B”)。于转换日(即 2016 年 5 月 13 日)，泰达宏利聚利债券基金的基金资产净值为 2,406,935,014.91 元，按照本基金的基金份额净值 1.000 元转换为 2,406,935,014.91 份泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金份额(其中，聚利 A 的基金资产净值为 1,355,349,958.68 元，转换为 1,355,349,958.68 份本基金份额；聚利 B 的基金资产净值为 1,051,585,056.23 元，转换为 1,051,585,056.23 份本基金份额)。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2016]第 317 号文审核同意，本基金场内交易总份额为 2,074,449,884.00 份，于 2016 年 5 月 25 日在深交所挂牌交易(交易代码：162215)。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，转换后，本基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变。本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与 A 股股票(包含中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票)的新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种。(但需符合中国证监会的相关规定)如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金在封闭期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%。在开放期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中债企业债总全价指数收益率  $\times$  90% + 中债国债总全价指数收益率  $\times$  10%。

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 2016 年 8 月 29 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利聚利分级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 2016 年 5 月 14 日（基金转型生效日）至 2016 年 6 月 30 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 5 月 14 日（基金转型生效日）至 2016 年 6 月 30 日止期间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

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[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于 OEF]、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。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股票、债券的转让收入免征增值税，对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，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

## 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	771,571.12
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	771,571.12

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	11,190,070.92	7,540,411.15	-3,649,659.77
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	462,226,692.60	460,411,467.80	-1,815,224.80
	银行间市场	1,194,693,198.97	1,207,475,600.00	12,782,401.03
	合计	1,656,919,891.57	1,667,887,067.80	10,967,176.23
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,668,109,962.49	1,675,427,478.95	7,317,516.46

### 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 2016年6月30日
应收活期存款利息	2,569.71
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	1,245.33
应收债券利息	26,983,909.56
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	17.10
合计	26,987,741.71

### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	-

待摊费用	29,140.31
合计	29,140.31

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	28,706.41
银行间市场应付交易费用	34,275.88
合计	62,982.29

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	258.47
预提费用	193,931.92
合计	194,190.39

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年5月14日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,406,935,014.91	1,582,104,870.50
- 基金份额折算调整	-	-
- 未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
- 集中申购募集资金本金及利息	-	-
- 基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	25,858.78	16,997.86
本期赎回（以“-”号填列）	-1,022,218,997.83	-671,869,975.71
本期末	1,384,741,875.86	910,251,892.65

注：1. 根据《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》和《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》，本基金合同生效后五年内封闭运作，不开放申购、赎回，在深圳证券交易所上市交易；基金封闭期结束后，本基金份额所分离的聚利 A 与聚利 B 将自动按转换规则转为上市开放式基金（LOF）的基金份额，并开放申购与赎回。

2. 截至 2016 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 952,797,147.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 431,944,728.86 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择

按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金转型生效日	821,019,046.15	3,811,098.26	824,830,144.41
本期利润	9,810,862.80	3,506,418.20	13,317,281.00
本期基金份额交易产生的变动数	-350,070,334.65	-1,432,848.30	-351,503,182.95
其中：基金申购款	8,906.20	59.55	8,965.75
基金赎回款	-350,079,240.85	-1,432,907.85	-351,512,148.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	480,759,574.30	5,884,668.16	486,644,242.46

#### 6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2016年5月14日至2016年6月30日
活期存款利息收入	34,939.21
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	8,529.28
其他	90.30
合计	43,558.79

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2016年5月14日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	9,203,642.07
减：卖出股票成本总额	14,905,105.27
买卖股票差价收入	-5,701,463.20

#### 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 2016年5月14日至2016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	1,168,860.47
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	1,168,860.47

#### 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
	2016年5月14日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	1,716,276,352.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,695,017,842.01
减：应收利息总额	20,089,650.30
买卖债券差价收入	1,168,860.47

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末未有债券投资收益-赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末未有债券投资收益-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

单位：人民币元

项目	本期
	2016年5月14日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	256,988.45
基金投资产生的股利收益	-
合计	256,988.45

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年5月14日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	3,506,418.20
——股票投资	6,609,451.42
——债券投资	-3,103,033.22
——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	-
合计	3,506,418.20

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年5月14日至2016年6月30日
基金赎回费收入	213,558.40
合计	213,558.40

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 5 月 14 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	18,772.29
银行间市场交易费用	9,740.00
合计	28,512.29

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 5 月 14 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	11,803.20
信息披露费	39,343.68
上市费	5,859.69
其他	-
银行费用	9,813.29
帐户维护费	-
合计	66,819.86

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期无或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期无资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 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。

###### 6.4.10.1.4 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。

###### 6.4.10.1.5 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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 5 月 14 日至 2016 年 6 月 30 日
当期应支付的管理费	1,753,153.70
其中：支付销售机构的客户维护费	60,739.35

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 0.7% 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 0.7% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 5 月 14 日至 2016 年 6 月 30 日
当期应支付的托管费	500,901.04

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

**6.4.10.3 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 2016年5月14日至2016年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	180,895,930.82	-	-	-	-	-

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 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**

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

**6.4.10.5 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 2016年5月14日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	771,571.12	34,939.21

本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况****6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额
127003	海印转债	2016年6月15日	2016年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	8,860	886,000.00	886,000.00

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601611	中国核建	2016年6月30日	临时停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	1,000	3,470.00	20,920.00	

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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 292,999,518.50 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
160402	16 农发 02	2016年7月1日	99.72	2,000,000	199,440,000.00
150314	15 进出 14	2016年7月7日	103.93	950,000	98,733,500.00
合计				2,950,000	298,173,500.00

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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 14,497,000.00 元，于 2016 年 7 月 8 日（先后）到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型证券投资基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与活期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，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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	-	373,394,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	346,558,600.00	704,170,000.00
合计	346,558,600.00	1,077,564,000.00

注：以上未评级的债券投资中包括国债、政策性金融债、央行票据以及超级短期融资券等。

#### 6.4.13.2.2 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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	170,413,467.00	446,480,003.35
AAA 以下	646,920,000.80	1,413,139,865.20
未评级	503,995,000.00	145,126,000.00
合计	1,321,328,467.80	2,004,745,868.55

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。

#### 6.4.13.3 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。本基金的流动性风险表现在两个方面：一是在某种情况下因市场交易量不足，某些投资品种的流动性不佳，可能导致证券不能迅速、低成本地转变为现金，进而影响到基金投资收益的实现；二是在本基金的开放日投资人的大量赎回或开放期投资人的大量连续赎回将会导致基金的现金支付出现困难，或迫使基金以不适当的价格大量抛售证券，使基金的净值增长率受到不利影响。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大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，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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。

于 2016 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 307,496,518.50 元将在 1 个月内到期且计息（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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	771,571.12	-	-	-	771,571.12
结算备付金	3,074,901.39	-	-	-	3,074,901.39
存出保证金	42,170.12	-	-	-	42,170.12
交易性金	591,811,767.00	915,371,091.00	160,704,209.80	7,540,411.15	1,675,427,478.95

融资产					
应收利息				26,987,741.71	26,987,741.71
应收申购款				6,855.65	6,855.65
其他资产				29,140.31	29,140.31
资产总计	595,700,409.63	915,371,091.00	160,704,209.80	34,564,148.82	1,706,339,859.25
负债					
卖出回购金融资产款	307,496,518.50				307,496,518.50
应付赎回款				380,884.60	380,884.60
应付管理人报酬				942,342.46	942,342.46
应付托管费				269,240.69	269,240.69
应付交易费用				62,982.29	62,982.29
应付利息				26,507.83	26,507.83
应交税费				71,057.38	71,057.38
其他负债				194,190.39	194,190.39
负债总计	307,496,518.50			1,947,205.64	309,443,724.14
利率敏感度缺口	288,203,891.13	915,371,091.00	160,704,209.80	32,616,943.18	1,396,896,135.11
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2015 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	4,780,532.44	-	-	-	4,780,532.44
结算备付金	14,115,613.96	-	-	-	14,115,613.96
存出保证金	259,548.07	-	-	-	259,548.07
交易性金融资产	1,328,620,571.28	1,510,660,825.25	243,028,472.02	58,267,937.92	3,140,577,806.47
应收证券清算款	-	-	-	997,146.32	997,146.32
应收利息	-	-	-	63,005,687.10	63,005,687.10
资产总计	1,347,776,265.75	1,510,660,825.25	243,028,472.02	122,270,771.34	3,223,736,334.36
负债					
卖出回购金融资产款	813,811,029.47	-	-	-	813,811,029.47
应付管理人报酬	-	-	-	1,422,275.35	1,422,275.35
应付托管费	-	-	-	406,364.38	406,364.38
应付交易费用	-	-	-	29,592.99	29,592.99
应交	-	-	-	62,942.82	62,942.82

税费					
应付利息				364,481.26	364,481.26
其他负债				150,000.00	150,000.00
负债总计	813,811,029.47			2,435,656.80	816,246,686.27
利率敏感度缺口	533,965,236.28	1,510,660,825.25	243,028,472.02	119,835,114.54	2,407,489,648.09

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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 2016年6月30日	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	8470000.00	15,040,000.00
	市场利率上升 25 个基点	-8360000.00	-14,860,000.00

#### 6.4.13.4.2 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。本基金在封闭期间，投资于固定收益类资

产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%。在开放期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券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 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资占基金资产净值比例为 0.54%（2015 年 12 月 31 日：2.42%），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（2015 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.14 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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

### 6.1 资产负债表（转型前）

会计主体：泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 5 月 13 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 5 月 13 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	722,512.94	4,780,532.44
结算备付金		5,169,957.60	14,115,613.96
存出保证金		41,081.24	259,548.07
交易性金融资产	6.4.7.2	2,033,274,584.00	3,140,577,806.47
其中：股票投资		15,832,595.00	58,267,937.92
基金投资		-	-
债券投资		2,017,441,989.00	3,082,309,868.55
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	325,000,762.50	-
应收证券清算款		-	997,146.32

应收利息	6.4.7.5	43,745,485.00	63,005,687.10
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,407,954,383.28	3,223,736,334.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年5月13日</b>	<b>上年度末 2015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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	813,811,029.47
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		597,003.41	1,422,275.35
应付托管费		170,572.41	406,364.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	37,950.13	29,592.99
应交税费		71,057.38	62,942.82
应付利息		-	364,481.26
应付利润		-	-
其他负债	6.4.7.8	142,785.04	150,000.00
负债合计		1,019,368.37	816,246,686.27
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,582,104,870.50	1,582,104,870.50
未分配利润	6.4.7.10	824,830,144.41	825,384,777.59
所有者权益合计		2,406,935,014.91	2,407,489,648.09
负债和所有者权益总计		2,407,954,383.28	3,223,736,334.36

注：1、报告截止日 2016 年 05 月 13 日，基金份额净值 1.521 元，基金份额总额 1,582,104,870.50 份，其中下属 A 类基金份额 1,107,473,410.47 份，B 类基金份额 474,631,460.03 份。下属 A 类基金份额净值 1.224 元，B 类基金份额净值 2.214 元。

2、2016 年 5 月 13 日为基金转型日。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 5 月 13 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至2016 年5月13日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
-----	-----	--------------------------------	-------------------------------------

<b>一、收入</b>		11,544,447.33	168,145,606.26
1. 利息收入		41,299,171.04	59,085,741.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	56,707.18	717,211.19
债券利息收入		40,887,417.90	55,388,738.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		355,045.96	2,979,791.22
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,123,390.57	143,829,080.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-16,314,510.14	7,136,594.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	29,483,799.23	133,037,008.17
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-45,898.52	3,655,478.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-42,878,114.28	-34,769,215.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		12,099,080.51	17,449,399.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,168,210.67	7,937,539.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,762,345.87	2,267,868.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	70,130.67	163,789.52
5. 利息支出		3,899,424.77	6,813,197.06
其中：卖出回购金融资产支出		3,899,424.77	6,813,197.06
6. 其他费用	6.4.7.20	198,968.53	267,004.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-554,633.18	150,696,206.42
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-554,633.18	150,696,206.42

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 5 月 13 日

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 5 月 13 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）	1,582,104,870.50	825,384,777.59	2,407,489,648.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-554,633.18	-554,633.18
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
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）	1,582,104,870.50	824,830,144.41	2,406,935,014.91
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	1,582,104,870.50	612,866,830.75	2,194,971,701.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	150,696,206.42	150,696,206.42
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
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）	1,582,104,870.50	763,563,037.17	2,345,667,907.67

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

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
傅国庆

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
王泉

会计机构负责人



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)由泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金(以下简称“泰达宏利聚利债券基金”)转型而来。根据《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,基金合同生效满五年后,满足基金合同约定的存续条件,泰达宏利聚利债券基金无需召开基金份额持有人大会,将自动转换为上市开放式基金(LOF),基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。原泰达宏利聚利债券基金更名为泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定。泰达宏利聚利债券基金于转换前的基金资产净值为 2,406,935,014.91 元,已于 2016 年 5 月 13 日全部转为本基金的基金资产净值,按照本基金的基金份额净值 1.000 元折合为 2,406,935,014.91 份泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金份额,并由本基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》、《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》和《泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)上市交易公告书》,泰达宏利聚利债券基金将基金份额持有人初始有效认购的基金总份额按照 7:3 的比例分离为预期收益与预期风险不同的两种份额类别,即优先类基金份额(基金份额简称“聚利 A”)和进取类基金份额(基金份额简称“聚利 B”)。于转换日(即 2016 年 5 月 13 日),泰达宏利聚利债券基金的基金资产净值为 2,406,935,014.91 元,按照本基金的基金份额净值 1.000 元转换为 2,406,935,014.91 份泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金份额(其中,聚利 A 的基金资产净值为 1,355,349,958.68 元,转换为 1,355,349,958.68 份本基金份额;聚利 B 的基金资产净值为 1,051,585,056.23 元,转换为 1,051,585,056.23 份本基金份额)。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2016]第 317 号文审核同意,本基金场内交易总份额为 2,074,449,884.00 份,于 2016 年 5 月 25 日在深交所挂牌交易(交易代码:162215)。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,转换后,本基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变。本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监

会允许基金投资的其他固定收益证券品种(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与 A 股股票（包含中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票）的新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种。（但需符合中国证监会的相关规定）如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金在封闭期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%。在开放期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中债企业债总全价指数收益率  $\times$  90% + 中债国债总全价指数收益率  $\times$  10%。

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 2016 年 8 月 29 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利聚利分级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 2016 年 1 月 1 日至 5 月 13 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 2016 年 5 月 13 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 5 月 13 日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[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于 OEF]、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。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股票、债券的转让收入免征增值税，对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，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

## 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 2016年5月13日
活期存款	722,512.94
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	722,512.94

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年5月13日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	26,091,706.19	15,832,595.00	-10,259,111.19
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	501,934,472.32	500,709,989.00
	银行间市场	1,501,437,307.23	1,516,732,000.00
	合计	2,003,371,779.55	2,017,441,989.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,029,463,485.74	2,033,274,584.00	3,811,098.26

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年5月13日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	325,000,762.50	-
合计	325,000,762.50	-

#### 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 2016年5月13日
应收活期存款利息	13,475.41
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	9,956.09
应收债券利息	43,704,426.86
应收买入返售证券利息	17,554.06
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	72.58
合计	43,745,485.00

#### 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 2016年5月13日
交易所市场应付交易费用	20,134.98
银行间市场应付交易费用	17,815.15
合计	37,950.13

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年5月13日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	142,785.04
合计	142,785.04

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰达宏利聚利 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 13 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,107,473,410.47	1,107,473,410.47
本期申购	-	-
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	1,107,473,410.47	1,107,473,410.47
泰达宏利聚利 B		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 5 月 13 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	474,631,460.03	474,631,460.03
本期申购	-	-
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	474,631,460.03	474,631,460.03

注：1. 根据《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》和《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》，本基金合同生效后五年内封闭运作，不开放申购、赎回，在深圳证券交易所上市交易；基金封闭期结束后，本基金份额所分离的聚利 A 与聚利 B 将自动按转换规则转为上市开放式基金(LOF)的基金份额，并开放申购与赎回。

2. 截至 2016 年 5 月 13 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 1,349,326,707.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 232,778,163.50 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

### 6.4.7.10 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
上年度末	778,695,565.05	46,689,212.54	825,384,777.59
本期利润	42,323,481.10	-42,878,114.28	-554,633.18
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	821,019,046.15	3,811,098.26	824,830,144.41

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年5月13日
活期存款利息收入	24,841.41
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	31,372.99
其他	492.78
合计	56,707.18

### 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

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年5月13日
卖出股票成交总额	25,599,082.06
减：卖出股票成本总额	41,913,592.20
买卖股票差价收入	-16,314,510.14

### 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 2016年1月1日至2016年5月13日
债券投资收益——买卖债券（、债	29,483,799.23

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	29,483,799.23

#### 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
	2016年1月1日至2016年5月13日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	2,207,317,756.23
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,115,940,433.65
减：应收利息总额	61,893,523.35
买卖债券差价收入	29,483,799.23

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-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

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年5月13日
股票投资产生的股利收益	-45,898.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	-45,898.52

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年5月13日
1. 交易性金融资产	-42,878,114.28
——股票投资	-530,160.72
——债券投资	-42,347,953.56
——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	-
合计	-42,878,114.28

### 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 2016年1月1日至2016年5月13日
交易所市场交易费用	51,905.67

银行间市场交易费用	18,225.00
合计	70,130.67

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年5月13日
审计费用	32,950.60
信息披露费	109,834.44
上市费	25,000.00
其他	800.00
银行费用	12,383.49
帐户维护费	18,000.00
合计	198,968.53

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期无或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

### 6.4.10.1.2 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。

### 6.4.10.1.3 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。

### 6.4.10.1.4 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。

### 6.4.10.1.5 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。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年5 月13日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,168,210.67	7,937,539.99
其中：支付销售机构的客户维护费	204,081.33	267,137.53

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 0.7% 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 0.7% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年5 月13日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,762,345.87	2,267,868.49

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

### 6.4.10.3 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度可比期间内均无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

##### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年5月13日		2015年1月1日至2015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
中国银行	722,512.94	24,841.41	1,064,298.56	42,966.60

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

##### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016年5月13日）本基金持有的流通受限证券

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

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额
120001	16 以岭 EB	2016 年 4 月 20 日	2016 年 6 月 16 日	新债未上市	100.00	100.00	10,550	1,055,000.00	1,055,000.00
128012	辉丰转债	2016 年 4 月 26 日	2016 年 5 月 17 日	新债未上市	100.00	100.00	17,790	1,779,000.00	1,779,000.00

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型证券投资基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

##### 6.4.13.1 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。

##### 6.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与活期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，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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	2016 年 5 月 13 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	171,025,000.00	373,394,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	100,230,000.00	704,170,000.00
合计	271,255,000.00	1,077,564,000.00

注：以上未评级的债券投资中包括国债、政策性金融债、央行票据以及超级短期融资券等。

#### 6.4.13.2.2 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	2016 年 5 月 13 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	106,104,102.00	446,480,003.35
AAA 以下	967,539,887.00	1,413,139,865.20
未评级	672,543,000.00	145,126,000.00
合计	1,746,186,989.00	2,004,745,868.55

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。

#### 6.4.13.3 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大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，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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。

于 2016 年 5 月 13 日本基金所承担的全部金融负债的合约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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本 期 末 2016 年 5 月 13 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
---	-------	-------	-------	-----	----

资产					
银行存款	722,512.94	-	-	-	722,512.94
结算备付金	5,169,957.60	-	-	-	5,169,957.60
存出保证金	41,081.24	-	-	-	41,081.24
交易性金融资产	755,868,374.80	1,010,310,774.50	251,262,839.70	15,832,595.00	2,033,274,584.00
买入返售金融资产	325,000,762.50	-	-	-	325,000,762.50
应收利息	-	-	-	43,745,485.00	43,745,485.00
资产总计	1,086,802,689.08	1,010,310,774.50	251,262,839.70	59,578,080.00	2,407,954,383.28
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	597,003.41	597,003.41
应付托管费	-	-	-	170,572.41	170,572.41
应付交易费用	-	-	-	37,950.13	37,950.13
应交税费	-	-	-	71,057.38	71,057.38
其他负债	-	-	-	142,785.04	142,785.04
负债总计	-	-	-	1,019,368.37	1,019,368.37
利率敏感度缺口	1,086,802,689.08	1,010,310,774.50	251,262,839.70	58,558,711.63	2,406,935,014.91
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计



2015 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	4,780,532.44	-	-	-	4,780,532.44
结算备付金	14,115,613.96	-	-	-	14,115,613.96
存出保证金	259,548.07	-	-	-	259,548.07
交易性金融资产	1,328,620,571.28	1,510,660,825.25	243,028,472.02	58,267,937.92	3,140,577,806.47
应收证券清算款	-	-	-	997,146.32	997,146.32
应收利息	-	-	-	63,005,687.10	63,005,687.10
资产总计	1,347,776,265.75	1,510,660,825.25	243,028,472.02	122,270,771.34	3,223,736,334.36
负债					
卖出回购金融资产款	813,811,029.47	-	-	-	813,811,029.47
应付管理人报酬	-	-	-	1,422,275.35	1,422,275.35
应付托管费	-	-	-	406,364.38	406,364.38
应付交易费用	-	-	-	29,592.99	29,592.99
应交税费	-	-	-	62,942.82	62,942.82
应付	-	-	-	364,481.26	364,481.26

利息					
其他 负债	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债 总计	813,811,029.47	-	-	2,435,656.80	816,246,686.27
利率 敏感 度缺 口	533,965,236.28	1,510,660,825.25	243,028,472.02	119,835,114.54	2,407,489,648.09

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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（2016年5月13日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个 基点	10,260,000.00	15,040,000.00
	市场利率上升 25 个 基点	-10,140,000.00	-14,860,000.00

#### 6.4.13.4.2 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。本基金在封闭期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%。在开放期间，投资于固定收

益类资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券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 2016 年 5 月 13 日，本基金持有的交易性权益类投资占基金资产净值比例为 0.66%（2015 年 12 月 31 日：2.42%），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（2015 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.14 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（转型后）

#### 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	7,540,411.15	0.44
	其中：股票	7,540,411.15	0.44
2	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	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	3,846,472.51	0.23
7	其他资产	27,065,907.79	1.59
8	合计	1,706,339,859.25	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

金额单位：人民币元

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

### 7.2.1 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。

### 7.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601611	中国核建	3,470.00	0.00

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600023	浙能电力	8,171,817.07	0.34
2	002521	齐峰新材	1,004,325.00	0.04
3	300511	雪榕生物	27,500.00	0.00

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	3,470.00
卖出股票收入（成交）总额	9,203,642.07

“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 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	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

### 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	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

### 7.7 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。

### 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股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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	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

### 7.12.6 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。

## § 7 投资组合报告（转型前）

### 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	15,832,595.00	0.66
	其中：股票	15,832,595.00	0.66
2	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	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	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	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,892,470.54	0.24
7	其他资产	43,786,566.24	1.82
8	合计	2,407,954,383.28	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

金额单位：人民币元

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

### 7.2.2 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。

### 7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300511	雪榕生物	8,410.00	0.00

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600023	浙能电力	12,397,276.00	0.51
2	002521	齐峰新材	10,597,942.66	0.44
3	601929	吉视传媒	2,298,355.56	0.10
4	002185	华天科技	245,102.00	0.01
5	603999	读者传媒	60,405.84	0.00

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	8,410.00
卖出股票收入（成交）总额	25,599,082.06

“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	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

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序号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	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

## 7.7 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。

## 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股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 7.12.6 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

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
2,534	546,464.83	1,285,585,547.03	92.84%	99,156,328.83	7.16%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	工银瑞信基金公司—农行—中国农业银行离退休人员福利负债	94,848,187.00	9.95%
2	中国工商银行股份有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限	55,026,694.00	5.78%
3	全国社保基金二二零组合	52,242,913.00	5.48%
4	全国社保基金二零三组合	44,478,379.00	4.67%
5	工银瑞信基金—工商银行—特定客户资产管理	42,098,616.00	4.42%
6	中国农业银行股份有限公司企业年金计划—中国银行股份有限公司	38,669,507.00	4.06%
7	全国社保基金二一四组合	32,177,730.00	3.38%
8	工行统筹外基金工银瑞信组合	30,746,771.00	3.23%
9	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	23,660,614.00	2.48%
10	瑞泰人寿保险有限公司-万能	23,099,971.00	2.42%

持有人为本基金场内持有人。

## 8.3 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	0.00%

## 8.4 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0.00	0.00%
本基金基金经理持有本开放式基金	0.00	0.00%

## § 9 开放式基金份额变动

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。

## § 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

- 1、本报告期内本公司未发生重大人事变动
- 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	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	
中银国际	1	22,927,854.47	65.88%	21,352.84	65.88%	-
湘财证券	1	11,874,869.66	34.12%	11,059.22	34.12%	-

(一) 本基金本报告期末新增、撤销席位。

(二) 交易席位选择的标准和程序：

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席位，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
中银国际	200,788,044.14	98.13%	11,000,000.00	0.23%	-	-
湘财证券	3,816,598.48	1.87%	4,799,432,000.00	99.77%	-	-

## 10.8 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》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年3月30日
2	《泰达宏利聚利分级债券型证	中国证券报、上海证	2016年5月10日

	券投资基金之聚利 A、聚利 B 终止上市的公告》	券报、证券时报、公司网站	
3	《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》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 10 日
4	《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》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 12 日
5	《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》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 12 日
6	《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》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 12 日
7	《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》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 17 日
8	《泰达宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 20 日
9	《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF) 开通系统内转托管业务和跨系统转托管业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 20 日
10	《泰达宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF) 开放申购、赎回、定期定额投资业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 23 日
11	《关于泰达宏利聚利债券型证	中国证券报、上海证	2016 年 5 月 24 日



	券投资基金（LOF）增加销售机构并参加其费率优惠活动的公告》	券报、证券时报、公司网站	
12	《关于泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）上市交易提示性公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 25 日
13	《关于泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）增加销售机构并参加其费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 28 日
14	《泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）参加民生证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 31 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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。

### 11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 11.3 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（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）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：客户服务中心电话：400-698-8888（免长话费）或 010-66555662，网址：<http://www.mfcteda.com>。

泰达宏利基金管理有限公司  
2016 年 8 月 29 日