

泰达宏利淘利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

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

重要提示

泰达宏利淘利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）2013年6月25日获中国证监会证监许可『2013』【837】号文注册，并于2014年7月7日获得中国证监会证券投资基金机构监管部关于泰达宏利淘利债券型证券投资基金延期募集备案的回函[2014]691号。本基金合同于2014年8月6日生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规性风险、本基金的特定风险和其他风险等等。本基金为债券型基金，属于证券市场中的较低风险品种，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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资者在认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本更新招募说明书摘要摘自更新招募说明书正文，投资者欲了解详细内容，应阅

读更新招募说明书正文。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2017 年 2 月 6 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 12 月 31 日。财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：泰达宏利基金管理有限公司

成立日期：2002 年 6 月 6 日

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

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

法定代表人：弓劲梅

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-66577808

信息披露联系人：陈沛

注册资本：一亿八千万元人民币

股权结构：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%

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、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金在内的四十多只证券投资基金。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

弓劲梅女士，董事长。拥有天津南开大学经济学博士学位。曾担任天津信托有限责任公司研究员，天弘基金管理有限公司高级研究员，天津泰达投资控股有限公司高级项目经理，天津市泰达国际控股（集团）有限公司融资与风险管理部副部长。现任天津市泰达国际控股（集团）有限公司资产管理部部长。

杨雪屏女士，董事。拥有天津大学工科学士和中国人民大学新闻学硕士学位。1995年至2003年曾在天津青年报社、经济观察报社、滨海时报社等报社担任记者及编辑；2003年至2012年就职于天津泰达投资控股有限公司办公室秘书科；自2012年至今就职于天津市泰达国际控股（集团）有限公司，曾担任资产管理部高级项目经理，现任综合办公室副主任。

刁锋先生，董事。拥有南开大学经济学学士、经济学硕士及经济学博士学位。曾担任天津北方国际信托股份有限公司交易员、信托经理，渤海财产保险股份有限公司资金运用部部门总助，天津泰达投资控股有限公司高级项目经理。现任天津市泰达国际控股（集团）有限公司财务部部长，渤海证券股份有限公司、渤海财产保险股份有限公司及天津信托有限责任公司董事等职。

何达德先生，董事。毕业于英国伦敦城市大学，取得精算学荣誉理事学士学位。现为宏利行政副总裁及宏利人寿保险（国际）有限公司首席行政总监，宏利资产管理（香港）有限公司首席行政总监，负责宏利于香港的全线业务，包括个人保险、雇员福利及财富管理等业务。同时何先生分别为宏利人寿保险（国际）有限

公司及宏利资产管理（香港）有限公司之董事。现为澳大利亚精算学会及美国精算学会会员，在寿险及退休顾问工作方面拥有三十多年的丰富经验，其间担任多个领导层要职。

杜汶高先生，董事。毕业于美国卡内基梅隆大学，持有数学及管理科学理学学士学位，现为宏利资产管理(亚洲)总裁兼亚洲区主管及宏利资产管理(香港)有限公司董事，掌管亚洲及日本的投资事务，专责管理宏利于区内不断壮大的资产，并确保公司的投资业务符合监管规定。出任现职前，杜先生掌管宏利于亚洲区(香港除外)的投资事务。2001年至2004年，负责波士顿领导机构息差产品的开发工作。杜先生于2001年加入宏利，之前任职于一家环球评级机构，曾获派驻纽约、伦敦及悉尼担任杠杆融资及资产担保证券等不同部门的主管，拥有二十多年的资本市场经验。

任赛华女士，董事。毕业于加拿大滑铁卢大学（University of Waterloo），获得数学学士学位，加拿大安大略省会计师公会之特许会计师。任女士于2007年加盟宏利资产，曾任首席行政事务总监，现担任宏利资产亚洲区零售经销部主管。早年任女士曾任职于亚洲和加拿大的著名国际投资银行、会计事务所及省级退休金委员会，监管托管业务的销售及担任全球基金服务客户关系管理、新业务发展及会计等高级职务。2013年6月至2015年4月担任泰达宏利基金管理有限公司监事。

刘建先生，董事。先后毕业于中国政法大学、天津财经学院，获法学学士、经济学硕士学位。1988年至2001年任中国建设银行股份有限公司金融机构部副处长；2001年至2003年任中信银行股份有限公司资金清算中心负责人；2003年至2014年任中银国际证券有限责任公司机构业务部董事总经理。2014年10月加盟泰达宏利基金管理有限公司，2015年4月任公司副总经理，2015年8月起任公司总经理。

何自力先生，独立董事，1982年毕业于南开大学，经济学博士。1975年至1978年，于宁夏国营农场和工厂务农和做工；1982年至1985年，于宁夏自治区党务从事教学和科研工作；1988年至今任职于南开大学，历任经济学系系主任、经济学院副院长，担任教授、博士生导师；兼任中国经济发展研究会副会长和秘书长、天津经济学会副会长；2002年1月至7月在美国加利福尼亚大学伯克利分校作访问学者。

张建强先生，独立董事。二级律师，南开大学法学学士、国际经济法硕士。曾担任天津市高级人民法院法官。现任天津建嘉律师事务所主任，天津仲裁委员会仲裁员，天津市律师协会理事，担任天津市政府、河西区政府、北辰区政府，多家

银行和非银行金融机构法律顾问，万达、招商、保利等房地产企业法律顾问，以及天津物产集团等大型国有企业的法律顾问等职。主要业务领域：金融、房地产、公司、投资。

查卡拉·西索瓦先生，独立董事。拥有艾戴克高等商学院（北部）工商管理学士、法国金融分析学院财务分析学位、芝加哥商学院工商管理学硕士等学位。曾担任欧洲联合银行（巴黎）组合经理助理、组合经理，富达管理与研究有限公司

（东京）高级分析师，NatWest Securities Asia 亚洲运输研究负责人，Credit Lyonnais International Asset Management 研究部主管、高级分析师，

Comgest 远东有限公司董事总经理、基金经理及董事。现任 Jayu Ltd. 负责人。

濮睿波先生，独立董事。拥有美国西北大学经济学学士、美国西北大学凯洛格管理学院管理学硕士、美国西北大学凯洛格管理学院金融学博士等学位。曾担任联邦储备系统管理委员会金融经济师，芝加哥商业交易所高级金融经济师，Ennis Knupp & Associates 合伙人、研究主管，Martingale 资产管理公司（波士顿）董事，Commerz 国际资本管理（CICM）（德国）联合首席执行官/副执行董事，德国商业银行（英国）资产管理部门董事总经理。现任上海交通大学高级金融学院实践教授。

2、监事会成员

许宁先生，监事长。毕业于南开大学，经济学硕士。1991年至2008年任职于天津市劳动和社会保障局；2008年加入天津市泰达国际控股（集团）有限公司，担任党委委员、董事会秘书、综合办公室主任。

陈景涛先生，监事。拥有澳大利亚麦考瑞大学商学学士、麦考瑞大学应用金融学硕士和南澳大学金融学博士学位。1998年先后就职于渣打银行、巴克莱资本、Baron Asset Management；2005年加入宏利资产，曾担任固定收益高级投资经理，现担任北亚投资负责人。

廖仁勇先生，职工监事，人力资源管理在职研究生，曾在联想集团有限公司、中信国检信息技术有限公司从事人力资源管理工作；2007年6月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾任人力资源部招聘与培训主管、人力资源部总经理助理，自2014年10月起担任人力资源部副总经理，主持部门工作。

葛文娜女士，职工监事。文学学士，金融学在职研究生。2006年7月至2015年12月就职于中邮创业基金管理有限公司，历任渠道经理、机构主管、销售部门总经理助理；2016年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，任销售管理部副总经理，主持部门工作。

3、高级管理人员

弓劲梅女士，董事长。简历同上。

刘建先生，总经理。简历同上。

傅国庆先生，副总经理。毕业于南开大学和美国罗斯福大学，获文学学士和工商管理硕士学位，北京大学国家发展研究院 EMBA。1993 年至 2006 年就职于北方国际信托股份有限公司，从事信托业务管理工作，期间曾任办公室主任、研发部经理、信托业务总部总经理、董事会秘书、以及公司副总经理。2006 年 9 月起任泰达宏利基金管理有限公司财务总监；2007 年 1 月起任公司副总经理兼财务总监。

王彦杰先生，副总经理。毕业于台湾中山大学和淡江大学，获企业管理学士和财务金融硕士学位。1998 年 8 月至 2001 年 4 月，先后在国际证券、日商大和证券、元大投信担任股票分析师；2001 年 5 月至 2008 年 2 月，任保德信投信股票投资主管；2008 年 2 月至 2008 年 8 月，就职于复华投信香港资产管理公司，担任执行长；2008 年 8 月至 2015 年 10 月，就职于宏利资产管理有限公司，担任台湾地区投资主管；2015 年 10 月加盟泰达宏利基金管理有限公司担任投资总监，2015 年 12 月起任泰达宏利基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

张萍女士，督察长。毕业于中国人民大学和中国科学院，管理学和理学双硕士。先后任职于中信公司、毕马威国际会计师事务所等公司，从事财务管理和管理咨询工作。2002 年起在嘉实基金管理有限公司工作，任监察稽核部副总监。2005 年 10 月起任泰达宏利基金管理有限公司风险管理部总监。2006 年 11 月起任泰达宏利基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

丁宇佳女士，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；2015 年 3 月 26 日起担任泰达宏利货币市场基金基金经理；2015 年 6 月 11 日至今担任泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）基金经理；2015 年 6 月 11 日至今担任泰达宏利创盈灵活配置型证券投资基金基金经理；2015 年 6 月 16 日至今担任本基金基金经理；2015 年 6 月 16 日至今担任泰达宏利养老收益混合型证券投资基金基金经理；2015 年 6 月 16 日起至今担任泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015 年 6 月 18 日起至今担任泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015 年 11 月 4 日起担任泰达宏利活期友货币市场基金基金经理；2016 年 9 月 26 日至今担任泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016 年 9 月 26 日至今担任泰达宏利风险预算混合型证券投资基金基金经理；2016 年 9 月 26 日至今担任泰达宏利集

利债券型证券投资基金基金经理；2016年9月29日至今担任泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年11月23日至今担任泰达宏利京元宝货币市场基金基金经理；2016年11月25日至今担任泰达宏利纯利债券型证券投资基金基金经理；2017年1月22日至今担任泰达宏利恒利债券型证券投资基金基金经理。具备9年基金从业经验，9年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

本基金历任基金经理：胡振仓先生，自2014年8月至2015年6月管理本基金。

5、投资决策委员会成员名单

投资决策委员会由公司总经理刘建、副总经理兼投资总监王彦杰、投资副总监兼基金投资部总监邓艺颖、金融工程部门负责人戴洁、研究部总监陈伯祯、资深基金经理兼首席策略分析师庄腾飞组成。督察长张萍列席会议。

投资决策委员会根据决策事项，可分类固定收益类事项、权益类事项、其它事项。

1) 固定收益类事项由刘建、王彦杰表决。

2) 权益类事项由刘建、王彦杰、邓艺颖、戴洁、陈伯祯、庄腾飞表决。

3) 其它事项由全体成员参与表决。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

(二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%

以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2016 年 12 月 31 日，中国银行已托管 534 只证券投资基金，其中境内基金 500 只，QDII 基金 34 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

1) 泰达宏利基金管理有限公司直销中心

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

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

联系人：于贺

联系电话：010-66577617

客服信箱：irm@mfcteda.com

客服电话：400-698-8888

传真：010-66577760/61

公司网站：<http://www.mfcteda.com>

2) 泰达宏利基金网上直销系统

（1）网上交易系统网址：<https://etrade.mfcteda.com/etrading/>

支持基金管理人旗下基金网上交易系统的银行卡和第三方支付有：农业银行卡、建设银行卡、民生银行卡、招商银行卡、兴业银行卡、中信银行卡、光大银行卡、交通银行卡、浦发银行卡、中国银行卡、广发银行卡、上海银行卡、汇付天下支付和快钱支付等。

（2）泰达宏利微信公众账号：mfcteda_BJ

支持民生银行卡、招商银行卡、汇付天下支付和快钱支付。

客户服务电话：400-698-8888 或 010-66555662

客户服务信箱：irm@mfcteda.com

2、销售机构

1) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

银行网站：www.boc.cn

2) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客服电话：95599

银行网站：www.abchina.com

3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

银行网址：www.bankcomm.com

4) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

公司网站：www.cmbchina.com

5) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：（021）61618888

传真：（021）63604199

联系人：虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

6) 东莞银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区体育路 21 号

办公地址：广东省东莞市莞城区体育路 21 号

法定代表人：卢国峰

电话：0769-22119061

传真：0769-22117730

联系人：陈幸

客服电话：4001196228

公司网站：www.dongguanbank.cn

7) 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河东区海河东路 218 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

电话：022-58316666

传真：022-58316259

联系人：王宏

客户服务热线：95541

公司网站：www.cbhb.com.cn

8) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-89068340

传真：0574-87050024

联系人：胡技勋

客户服务热线：95574

公司网站：www.nbc.com.cn

9) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

办公地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

电话：021-38637673

传真：021-50979507

联系人：张莉

客户服务热线：95511-3

公司网站：bank.pingan.com

10) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

联系人：陈春林

传真：(010) 68858117

公司网址：www.psbc.com

11) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：胡天彤

电话：022-28451709

传真：022-28451892

电子邮箱：hutt@bhq.com

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.bhq.com

12) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

客户服务电话：95597

传真：0755-82492962

联系人：庞晓芸

公司网站：www.htsc.com.cn

13) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008-888-888

电话：010-66568292

联系人：邓颜

公司网站：www.chinastock.com.cn

14) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客服电话：400-888-8108

传真：010-65182261

公司网站：www.csc108.com

15) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客服电话：400-888-8666/95521

联系人：芮敏祺

公司网站：www.gtja.com

16) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：吴琼

全国免费业务咨询电话：95511-8

传真：0755-82400862

网址：www.PINGAN.com

17) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系电话：021-33389888

客服电话：95523 或 400-889-5523

网址：www.swhysc.com

18) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

法定代表人：许建平

电话：010-88085858

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

19) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

20) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

客户服务电话：400-600-0686

网址：www.nesc.cn

21) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

客户服务电话：95525 400-888-8788 101-089-98

传真：021-22169134

公司网址：www.ebscn.com

22) 新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

联系人：孙恺

客户服务电话：400-698-9898

公司网址：www.xsdzq.cn

23) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

联系电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565，400-888-8111

公司网址：www.newone.com.cn

24) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000 400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

25) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20 层

法定代表人：兰荣

联系人：黄英

联系电话：0591-38162212

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

26) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客服电话：95553，400-8888-001

联系电话：021-23219000

公司网站: www.htsec.com

27) 广州证券股份有限公司

注册地址: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼

办公地址: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼

法定代表人: 邱三发

客服电话: 020-961303

联系电话: 020-88836999

传真: 020-88836654

联系人: 林洁茹

网址: www.gzs.com.cn

28) 华福证券有限责任公司

注册地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人: 黄金琳

客服电话: 96326 (福建省外请先拨 0591)

传真: 0591-87383610

联系人: 张宗锐

公司网站: www.hfzq.com.cn

29) 金元证券股份有限公司

注册地址: 海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址: 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人: 陆涛

客户服务电话: 400-888-8228

传真: 0755-83025625

联系人: 马贤清

网站: www.jyzq.cn

30) 德邦证券股份有限公司

注册地址: 上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址: 上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平
客服电话：400-888-8128
传真：021-68767981
联系人：朱磊
公司网站：www.tebon.com.cn

31) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元
办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元
法定代表人：王连志
客服电话：400-800-1001
联系人：陈剑虹
联系电话：0755-82825551
网址：www.essence.com.cn

32) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层
办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦
法定代表人：赵俊
联系人：王一彦
电话：021-20333333
传真：021-50498825
公司网络地址：www.longone.com.cn
客服电话：95531，400-888-8588

33) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层（100007）
办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层（100007）
法定代表人：常喆
客户服务电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com

34) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼（410005）

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼（410005）

法定代表人：蔡一兵

联系人：郭磊

联系电话：0731-84403319

开放式基金业务传真：0731-84403439

网址：www.cfzq.com

35) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579 或 400-888-8999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：www.95579.com

36) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系电话：028-86690057、028-86690058

联系人：刘婧漪、贾鹏

公司网址：www.gjzq.com.cn

客服热线：95310

37) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

公司网址：www.citics.com

客服热线：95548

38) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市永和路 118 弄 24 号楼

法定代表人：陈宏

公司网址：www.xzsec.com

客服热线：400-911-2233

39) 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

办公地址：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

公司网址：www.westsecu.com

客服热线：95582

40) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7、8 层，深圳市华侨城深南大道 9010 号

法定代表人：吴永良

公司网址：www.zszq.com

客服热线：400-102-2011

41) 九州证券股份有限公司

注册地址：西宁市城中区西关大街 11 号

办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园东一门 2 号楼

法定代表人：曲国辉

公司网址：www.jzsec.com

客服热线：400-654-3218

42) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：周俊

电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

公司网址：www.jhzq.com.cn

客服热线：400-666-2288

43) 万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层

办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层

法定代表人：张建军

公司网址：www.wlzq.com.cn

客服热线：400-888-8133

44) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼20层

办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼第20层

法定代表人：杨宝林

公司网址：www.citicssd.com

客服热线：95548

45) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦5楼

法定代表人：吴坚

公司网址：www.swsc.com.cn

客服热线：400-809-6096

46) 上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼

办公地址：上海黄浦区南京西路399号明天广场22楼

法定代表人：郭林

客服电话：4008-205-999

电话：021-63898951

联系人：李颖

公司网站: www.shhxzq.com

47) 中信期货有限公司

注册地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人: 张皓

公司网址: www.citicsf.com

客服电话: 400-990-8826

48) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址: 上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 68 号 8 楼

法定代表人: 汪静波

公司网址: www.noah-fund.com

客服热线: 400-821-5399

49) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址: 深圳市罗湖区梨园路 1 号物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人: 薛峰

公司网址: www.zlfund.cn; www.jjmmw.com

客服热线: 4006-788-887

50) 上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址: 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人: 杨文斌

公司网址: www.ehowbuy.com

客服热线: 400-700-9665

51) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址: 杭州市西湖区天目山路 266 号黄龙时代广场 B 座支付宝

法定代表人：陈柏青

客服电话：400-076-6123

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

52) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C-9 楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

53) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：刘潇

电话：021-021-20691942

传真：021-20691861

客服电话：400-820-2899

公司网址：www.erichfund.com

54) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：刘洋

联系电话：021-20835817

传真号码：021-20835885

全国统一客服热线：400-920-0022/ 021-20835588

公司网址：licaike.hexun.com

55) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦二层

法定代表人：闫振杰

全国统一客服热线：400-888-6661

公司网址：www.myfund.com

56) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层

法定代表人：凌顺平

客户服务热线：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

57) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室

地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

客户服务热线：400-001-1566

公司网址：www.yilucaifu.com

58) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

客户服务热线：400-820-2819

公司网址：<https://tty.chinapnr.com>

59) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

客户服务热线：400-821-9031

公司网址：www.lufunds.com

60) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址: 南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

地址: 上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人: 袁顾明

客户服务热线: 400-928-2266

公司网址: <http://www.dtfortune.com>

61) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址: 浙江省杭州市拱墅区登云路 45 号(锦昌大厦) 1 幢 10 楼 1001 室

地址: 浙江省杭州市拱墅区登云路 45 号(锦昌大厦) 1 幢 10 楼 1001 室

法定代表人: 徐黎云

客户服务热线: 400-068-0058

公司网址: <http://www.jincheng-fund.com>

62) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

地址: 北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 17 层

法定代表人: 杨懿

客户服务热线: 400-166-1188

公司网址: <http://money.jrj.com.cn>

63) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

地址: 上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人: 燕斌

客户服务热线: 400-046-6788

公司网址: <http://www.66money.com>

64) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人: 钟斐斐

客服热线: 4000-618-518

网址: www.ncfjj.com

65) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址: 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第七幢 23 层 1 号 4 号

办公地址: 武汉市泛海国际 SOHO 城 7 栋 2301、2304

法定代表人: 陶捷

公司网址: <http://www.buyfunds.cn>

客服热线: 400-027-9899

66) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

地址: 北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层 2302#

法定代表人: 李悦

客户服务热线: 4008-980-618

公司网址: www.chtfund.com

67) 北京广源达信投资管理有限公司

注册地址: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址: 北京市朝阳区宏泰东街浦项中心 B 座 19 层

法定代表人: 齐剑辉

公司网址: <http://www.niuguwang.com>

客服热线: 400-623-6060

68) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人: 蒋煜

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 21-28 层

公司网址: www.gscaifu.com

客服热线: 400-818-8866

69) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人: 李昭琛

客服电话: 010-62675369

公司网址: <http://www.xincai.com/>

70) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人: 肖雯

客服电话: 020-89629066

公司网址: www.yingmi.cn

71) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室 (上海泰和经济发展区)

办公地址: 上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人: 王翔

电话: 021-65370077-209

公司网站: www.jiyufund.com.cn

72) 北京汇成基金管理有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人: 王伟刚

客服电话: 400-619-90595

网址: www.fundzone.cn

73) 上海云湾投资管理有限公司

注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

法定代表人: 戴新装

企业类型: 有限责任公司

营业期限: 持续经营

客服电话: 400-820-1515

网址: www.zhengtongfunds.com

74) 上海万得投资顾问有限公司

注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人: 王廷富

注册资本：人民币 2000 万元

企业类型：有限责任公司

电话：021-5132 7185

传真：021-5071 0161

75) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 a 座 17 层

法定代表人：陈超

联系人：赵德赛

客服电话：95518/400 088 8816

公司网址：[http://fund. jd. com](http://fund.jd.com)

76) 天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室

办公地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室

法定代表人：丁东华

公司网址：[www. gomefund. com](http://www.gomefund.com)

客服热线：400-111-0889

77) 北京格上富信投资顾问有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

联系人：曹庆展

客户服务电话：400-066-8586

公司网址：[www. igesafe. com](http://www.igesafe.com)

78) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号

法定代表人：林卓

客服电话：400-6411-999

网址：www.taichengcaifu.com

二) 登记机构

名称：泰达宏利基金管理有限公司

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

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

法定代表人：弓劲梅

联系人：石楠

联系电话：010-66577769

传真：010-66577750

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：吕红、黎明

联系人：黎明

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

法定代表人：赵柏基

经办注册会计师：单峰、庞伊君

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：庞伊君

四、基金的名称

泰达宏利淘利债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：债券型

本基金运作方式：契约型开放式

本基金存续期：不定期

六、基金的投资目标

在有效控制风险的基础上，通过主动管理，力争创造高于业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的债券类金融工具，包括企业债券、公司债券、短期融资券、地方政府债券、商业银行金融债券、商业银行次级债、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、逆回购、国债、中央银行票据、政策性金融债券、中期票据、银行存款等，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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金不直接从一级、二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可持有因可转换债券转股所形成的股票、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，但基金管理人应当在 10 个交易日内进行卖出。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的资产占基金资产的比例不低于 80%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

依托基金管理人自身债券评级体系和风险控制措施，通过基金主动的管理，采用自上而下和自上而上相结合的投资策略，实现风险和收益的最佳配比。

1、债券类属配置策略

本基金将根据对政府债券、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，确定债券类属配置策略，并根据市场变化及时进行调整，从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的类属债券配置比例。

2、久期管理策略

本基金将根据对利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减少组合久期，以规避债券价格下降的风险。

3、收益率曲线策略

本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上，将结合收益率曲线变化的预测，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。

4、信用债券投资策略

本基金将主要通过买入并持有信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用债券产品，获取票息收益。此外，本基金还将通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断，主动采用信用利差投资策略，获取利差收益。

5、特殊债券品种投资策略

（1）可转换公司债券投资策略

在综合分析可转换公司债券的股性特征、债性特征、流动性、摊薄率等因素的基础上，本基金采用 Black-Scholes 期权定价模型和二叉树期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，选择其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好，并且基础股票基本面优良、具有较强盈利能力、成长前景好、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种，以合理价格买入并持有。根据内含收益率、折溢价比率、久期、凸性等因素构建可转换公司债券投资组合，获取稳健的投资回报。此外，本基金将通过分析不同市场环境下可转换公司债券股性和债性的相对价值，通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求选择被市场低估的品种。

（2）资产支持证券投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券

（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。

本基金将在债券市场宏观分析基础上，结合蒙特卡洛模拟等数量化方法，对资产支持证券进行定价，评估其内在价值进行投资。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中债总财富总指数。

中债总财富总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。该

指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要债券类证券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在基金管理人和基金托管人协商一致，履行适当程序后变更业绩比较基准，报证监会备案并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券市场中的较低风险品种，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。

十一、基金的投资组合（未经审计）

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 2017 年 2 月 20 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。

本投资组合报告所载数据截止 2016 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

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 --

其中：股票 --

2 基金投资 --

3 固定收益投资 5,028,545,849.00 81.49

其中：债券 5,008,409,849.00 81.16

资产支持证券 20,136,000.00 0.33

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 962,002,723.00 15.59

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 118,840,030.58 1.93

8 其他资产 61,566,522.01 1.00
9 合计 6,170,955,124.59 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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。

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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 827,905,000.00 13.88
其中：政策性金融债 827,905,000.00 13.88
4 企业债券 472,264,209.60 7.92
5 企业短期融资券 2,691,411,000.00 45.11
6 中期票据 990,810,000.00 16.61
7 可转债 26,019,639.40 0.44
8 同业存单 --
9 其他 --
10 合计 5,008,409,849.00 83.94

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 011611010 16大唐集 SCP010 600,000 60,252,000.00 13.27
2 011699685 16中建材 SCP004 600,000 60,072,000.00 13.23
3 011698300 16鲁商 SCP007 600,000 59,808,000.00 13.17
4 011698709 16现代投资 SCP002 400,000 41,184,000.00 9.07
5 011698725 16国电 SCP006 300,000 30,531,000.00 6.73

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.1 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。

9.2 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。

9.3 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。

10、投资组合报告附注

10.1

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。

10.2

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。

11、其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 22,376.44

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 61,543,609.66

5 应收申购款 535.91

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 61,566,522.01

12、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 113009 广汽转债 7,896,160.00 0.13

2 110035 白云转债 851,990.40 0.01

13、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

14、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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2014年8月6日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

(一) 截止2016年12月31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：

泰达淘利债券 A

阶段 基金净值收益率

① 基金净值收益率标准差② 比较基准收益率

③ 比较基准收益率标准差

④ ①-③ ②-④

2014年8月6日至2014年12月31日 6.20% 0.27% 5.24% 0.19% 0.96% 0.08%

2015年1月1日-2015年12月31日 10.92% 0.12% 8.03% 0.11% 2.89% 0.01%

2016年1月1日-2016年12月31日 2.63% 0.06% 1.30% 0.12% 1.33% -0.06%

2014年8月6日至2016年12月31日 20.90% 0.14% 15.16% 0.13% 5.74%

0.01%

泰达淘利债券 B

阶段 基金净值收益率

① 基金净值收益率标准差② 比较基准收益率

③ 比较基准收益率标准差

④ ①-③ ②-④

2014年8月6日至2014年12月31日 5.90% 0.26% 5.24% 0.19% 0.66% 0.07%

2015年1月1日-2015年12月31日 11.05% 0.13% 8.03% 0.11% 3.02% 0.02%

2016年1月1日-2016年12月31日 2.38% 0.06% 1.30% 0.12% 1.08% -0.06%

2014年8月6日至2016年12月31日 20.40% 0.14% 15.16% 0.13% 5.24%

0.01%

本基金的业绩比较基准：中债总财富总指数

（二）泰达宏利淘利基金自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图（2014年8月6日-2016年12月31日）

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。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、B类份额的销售服务费；

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日 B 类份额基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中划出，由登

记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3—7项及第9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

（一）在“重要提示”中，更新了招募说明书所载内容、有关财务数据和净值表现的截止日期。

（二）对“三、基金管理人”中，基金管理人概况、董事会成员、监事会成员、基金经理等部分进行了变更。

（三）“四、基金托管人”部分进行了更新。

（四）“五、相关服务机构”中，更新直销机构、代销机构及补充第三方销售机构。

（五）“八、基金份额的申购与赎回”中部分进行更新及增加内容。

（六）“九、基金的投资”部分投资组合报告内容更新至2016年12月31日。

（七）“十、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2016年12月31日，并更新了历史走势对比图。

（八）更新了“二十二、其他应披露事项”部分内容。

泰达宏利基金管理有限公司

2017年3月22日