

泰达宏利多元回报债券型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

本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。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 4 月 13 日（基金合同生效日）起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达多元回报债券	
基金主代码	002470	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 4 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	106,006,955.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰达多元回报债券 A	泰达多元回报债券 C
下属分级基金的交易代码:	002470	002471
报告期末下属分级基金的份额总额	56,577,441.08 份	49,429,514.39 份

2.2 基金产品说明

投资目标	严控本基金下行风险的前提下，灵活运用多种投资策略，为基金份额持有人创造较高的投资收益。
投资策略	本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，并在基金合同约定的资产配置范围内以投资时钟理论为指导，通过对经济周期所处的发展阶段及其趋势的分析和判断以及不同资产类别的预期表现，对基金资产配置进行动态调整，在有效控制投资组合风险的基础上，提高基金资产风险调整后收益。
业绩比较基准	中证全债指数收益率*90%+中证红利指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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@mfteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95566
传真		010-66577666	010-66594942

2.4 信息披露方式

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	基金管理人及基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	泰达多元回报债券 A	泰达多元回报债券 C
本期已实现收益	2,087,057.59	2,990,706.88
本期利润	1,779,317.59	2,089,734.20
加权平均基金份额本期利润	0.0175	0.0108
本期基金份额净值增长率	1.40%	1.20%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0140	0.0124
期末基金资产净值	57,370,505.26	50,044,515.87
期末基金份额净值	1.014	1.012

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. 期末可供分配利润等于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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰达多元回报债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④

过去三个月	0.00%	0.20%	-1.31%	0.17%	1.31%	0.03%
过去六个月	0.90%	0.17%	1.24%	0.14%	-0.34%	0.03%
自基金合同生效起至今	1.40%	0.14%	1.36%	0.13%	0.04%	0.01%

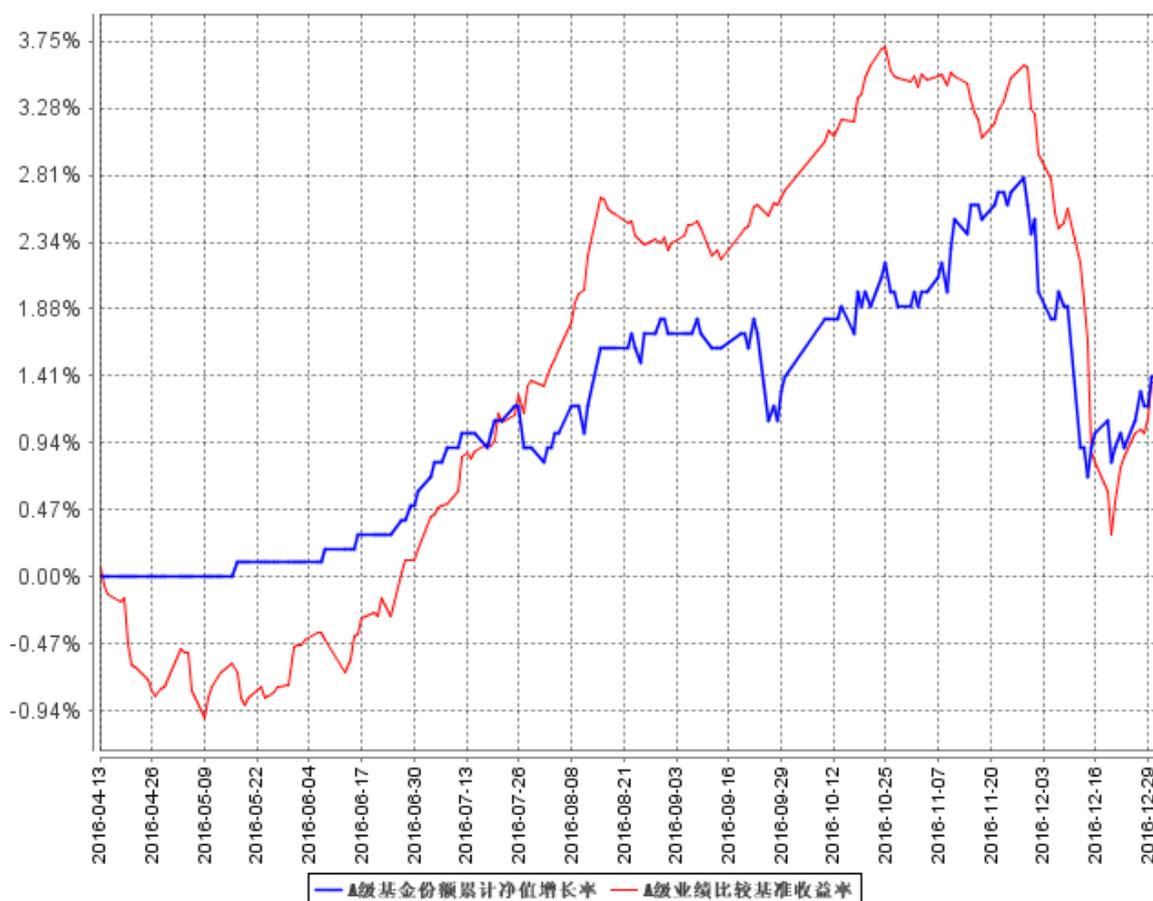
泰达多元回报债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.10%	0.21%	-1.31%	0.17%	1.21%	0.04%
过去六个月	0.70%	0.17%	1.24%	0.14%	-0.54%	0.03%
自基金合同生效起至今	1.20%	0.14%	1.36%	0.13%	-0.16%	0.01%

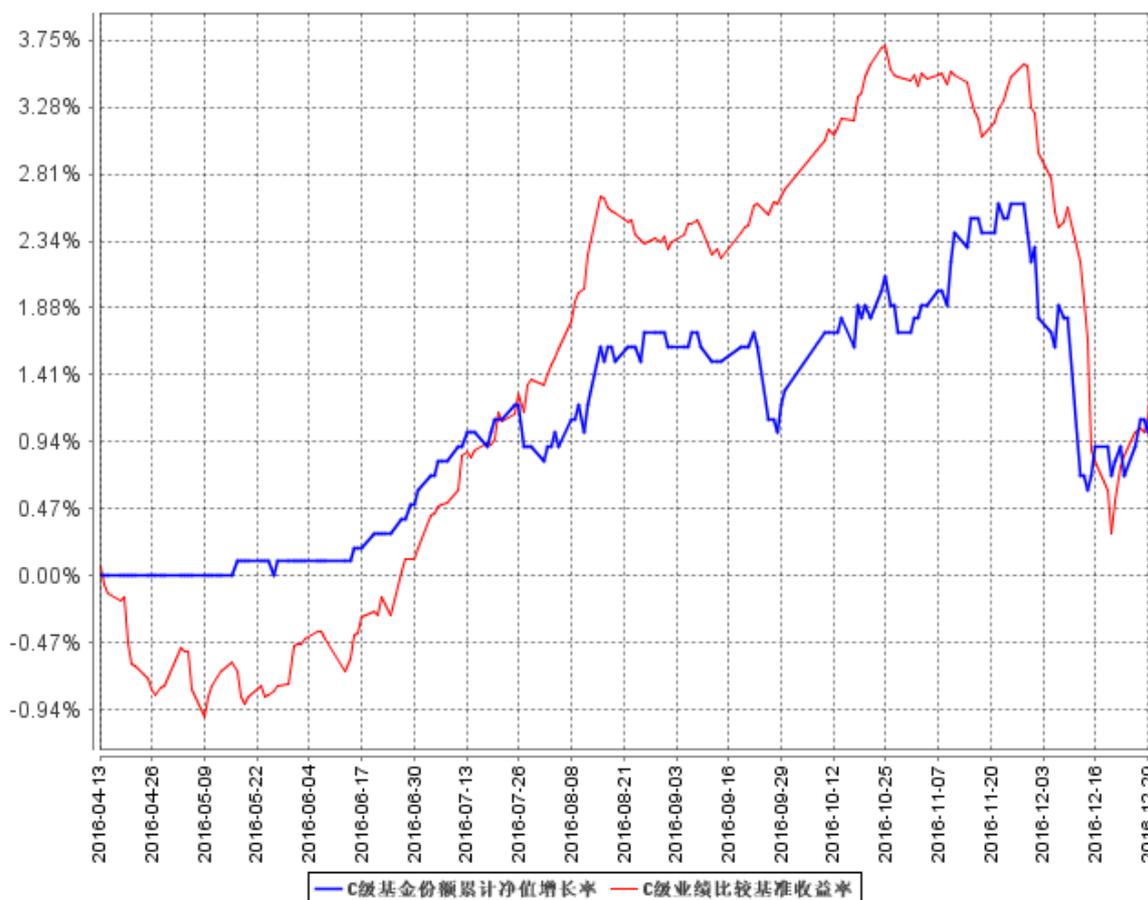
注：本基金业绩比较基准：中证全债指数收益率*90%+中证红利指数收益率*10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级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



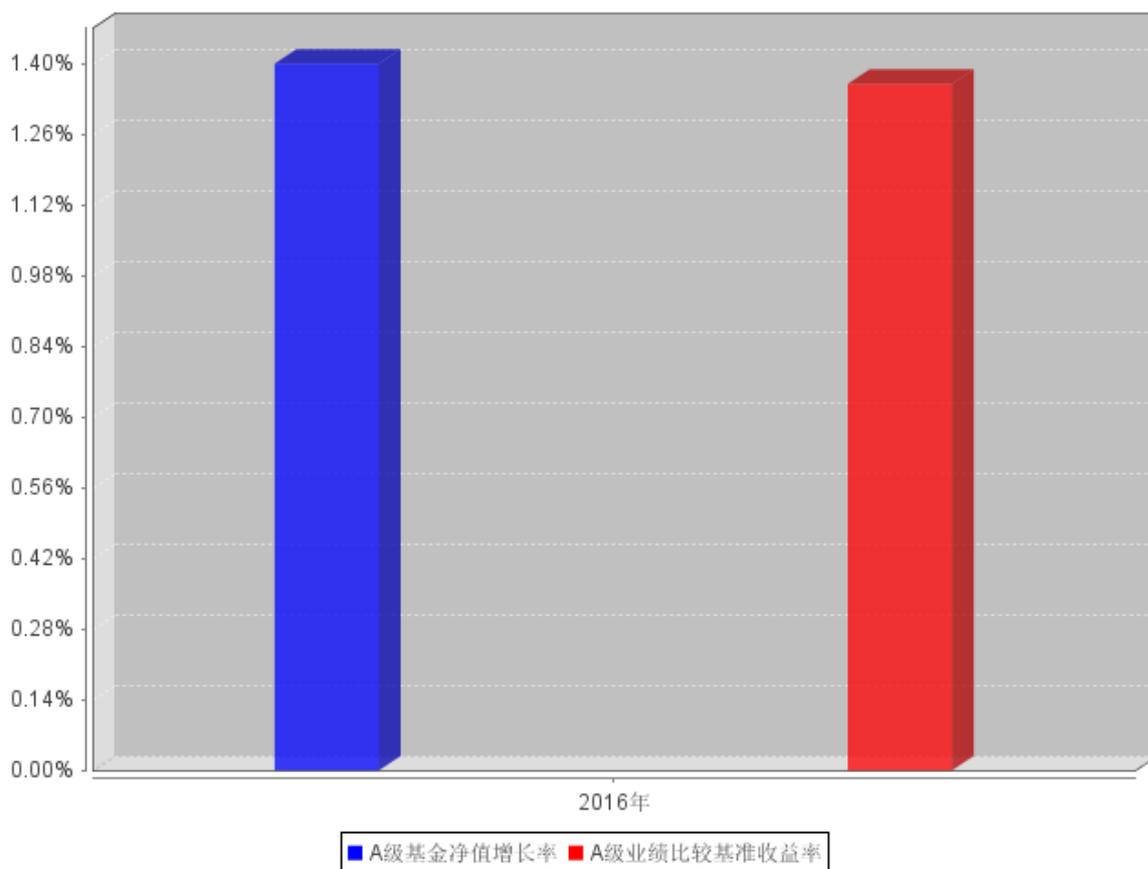
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



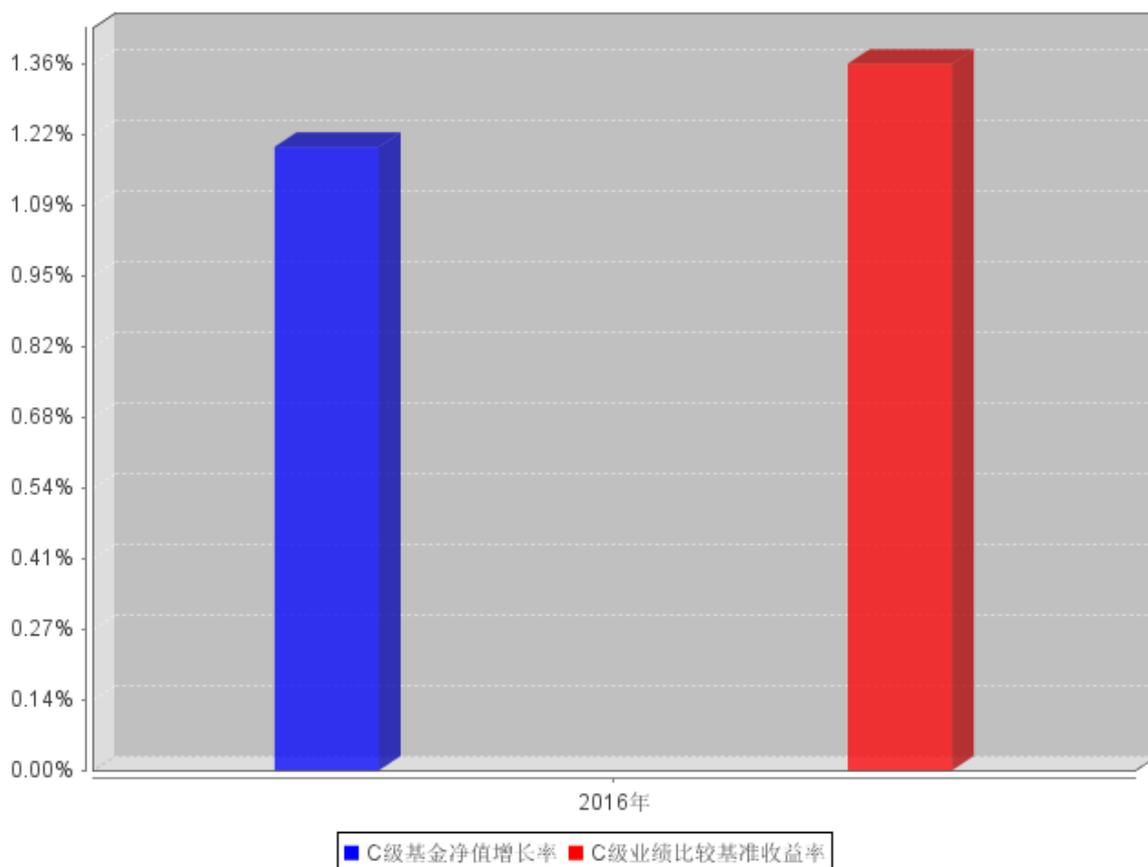
本基金成立于 2016 年 4 月 13 日，截止报告期末本基金成立不满一年。按基金合同规定，自基金合同生效日起六个月内为建仓期。本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



本基金成立于 2016 年 4 月 13 日，2016 年度净值增长率的计算期间为 2016 年 4 月 13 日至 2016 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于 2016 年 4 月 13 日生效。根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金自成立以来到本报告期末未进行利润分配。目前无其他收益分配安排。

§ 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、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在内的四十多只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资团队全体人员的共同努力，力求实现基金财产的持续增值。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘欣	基金经理； 金融工程部总经理	2016 年 9 月 26 日	-	9	理学硕士，2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉实基金管理有限公司；2011 年 7 月加盟泰达宏

					利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理，现担任金融工程部总经理；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。
庞宝臣	基金经理	2016 年 9 月 26 日	-	10	2006 年 7 月至 2011 年 8 月，任职于永安财产保险股份有限公司，担任投资经理，负责债券研究与投资工作；2011 年 9 月至 2012 年 8 月，任职于幸福人寿保险股份有限公司，担任高级经理、固定收益投资室负责人，负责债券投资工作；2012 年 9 月至 2014 年 9 月，任职于中华联合保险股份有限公司投资管理部，担任高级主管一职；2014 年 9 月至 2016 年 3 月 7 日，任职于中华联合保险控股股份有限公司，担任投资经理一职；2016 年 3 月加入泰达宏利基金管理有限公司；具备 10 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
卓若伟	基金经理	2016 年 4 月 13 日	2016 年 9 月 26 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；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、固定收益部总监；具备 12 年证券从业经验，10 年基金从业经验，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程，严格执行相关制度规定。在投资管理活动中，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；在交易环节实行集中交易制度，交易部运用交易系统内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，确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，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。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，未发现明显的非公平交易指令；基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组

合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

4.3.3 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 30 次。30 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

债券市场方面，2016 年海外经济弱复苏，外需情况改善有限，国内民间投资下滑带来下行压力，货币政策在前三个季度基调偏向宽松，刺激总需求，受益于低廉的资金成本，债券市场震荡上涨，交易投资活跃，收益率总体下滑，期限利差、信用利差显著压缩；4 季度去库存周期开始启动，同时供给侧改革推动工业品价格上涨，物价整体温和回升，非金融企业现金流和利润连续改善，经济运行出现向好迹象。政策关注焦点从稳增长过渡至控风险，央行货币政策开始收紧，并加强对非银金融机构的监管，叠加年末商业银行为提高备付金减少对非银机构资金供给，个别机构应对不足，出现流动性危机，导致债券市场出现了阶段性恐慌的局面，各品种收益率快速大幅上行，收益率曲线倒挂，市场波动显著扩大；信用债受流动性冲击更大，上行幅度明显高于国债，各等级信用利差快速回升至中位数以上水平。

股票市场方面，2016 年全年呈现震荡微跌格局，上市公司整体平均盈利增速开始从低位抬升，部分周期性行业有较强的盈利恢复。从板块层面看，低估值传统周期股受益于供给侧改革，具有一定涨幅；高分红绩优股票全年相对抗跌；高估值缺乏业绩支撑的前期热门股票跌幅较大。然而考虑到策略中小盘股票数目多，波动空间大，从全年看具有较强选股能力的部分中小盘基金业绩表现反而优于绩优大盘基金。这与主动组合投资基本规律相符，即投资结果取决于投资能

力与投资空间两者，而非仅前者。

报告期内，我们认为经济难有显著变化，债券估值偏低，但供需关系良好，结合本基金的特征，债券组合维持低风险敞口，坚持短久期策略，以持有票息为主；股票投资方面，本基金在操作中有效的进行了结构性调整，投资风格兼顾成长确定、估值合理、景气度较高的成长性公司，和估值低、基本面稳健、存在改善预期的蓝筹股，从结构上分散由于市场风格大幅波动造成的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

多元回报 A

截止报告期末，本基金份额净值为 1.014 元，自基金成立以来份额净值增长率为 1.40%，同期业绩比较基准增长率为 1.36%。

多元回报 C

截止报告期末，本基金份额净值为 1.012 元，自基金成立以来份额净值增长率为 1.20%，同期业绩比较基准增长率为 1.36%。

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 2017 年，我们认为经济基本面维持平稳，上、下行风险均不高，通胀有所弹升，但很难构成政策的掣肘因素。有利因素源于以下几个方面：1. 海外经济（美国）复苏趋势延续，人民币汇率已有一定幅度的贬值，以及一路一带进入逐步落地期，净出口改善可以期待；2. 国内投资方面，PPP 项目有望对冲地产投资回落，制造业投资见底回升；3. 居民可支配收入平稳增长，消费信贷周期仍在。

政策方面，中央经济工作会议显示，防风险放在更重要的位置上，稳经济相对靠后；我们更倾向于认为这样的表述传达出了中央对 2017 年经济增长的信心，而非取舍，货币政策会有所收紧，但力度和节奏不会太强，毕竟高利率去杠杆对经济的破坏过大，因此总体政策中性偏紧是主基调，加强监管仍然是政策的主要抓手；这意味着管理层对波动的容忍度会有所提升。

债券市场在经过快速下跌之后，从估值角度来看，高等级信用债、利率债收益率水平经过调整之后基本回到历史均值附近的水平，结合当前的经济形势，利率中枢水平继续上移的空间并不大；信用利差方面，首先政府加杠杆、实体去杠杆仍在继续，非金融企业盈利改善、资产负债表改善的趋势也未遭到破坏，信用基本面并未转向；但监管趋严以后，流动性溢价上升的可能性较大，预计信用利差有望走扩，但金融机构资本充足情况并未受到影响，盈利仍然是核心驱动，因此投资偏好也难发生根本性转变，意味着需求仍在，信用利差总体大幅提升的基础也不存在。

股票市场方面，经济基本面筑底正在持续被部分宏观和分行业微观指标验证。而另一方面，潜在的通胀因素正在逐渐累积，央行对资金面开始有所控制。预计未来政策将在稳增长和控通胀之间。市场面来看，整体股票估值不低。一方面，受益于供给侧改革，钢铁、化工、煤炭等传统周期行业盈利大幅修复，带动估值的进一步修复，并开始向其他周期性行业蔓延；另一方面，蓝筹高分红股票的配置优势能否维系，取决于未来资金利率能否维持在较低的中枢位置；中小盘具有业绩基础的公司具有长期配置价值，而概念股票尽管在年初可能有短期炒作空间，但长期会被证伪。从情绪面看，市场波动率处于历史低点，整体向下风险有限。在此环境下，我们对市场的看法倾向于中幅震荡格局。在对市场结构把握较好的情况下，可能会取得相对理想可观的回报。未来如果控通胀、稳增长、调结构三者的关系得到较高的协调，从长远看，2018-2020 年可能会出现较大规模的牛市，而 2017 年是一个较好的投资起点。

基于我们对市场的判断并结合本基金的特征，债券组合维持低风险敞口，坚持短久期策略，以持有票息为主；股票投资方面，我们的配置偏向于具有真实业绩成长且估值合理的股票。在交易时机上，选取情绪相对低迷的时点参与，在情绪过度亢奋期退出。本基金在持仓上相对分散，以平衡组合风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管基金运营的副总经理担任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金本报告期内未进行利润分配。目前无其他利润分配安排。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利多元回报债券型证券投资基金（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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21150 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰达宏利多元回报债券型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的泰达宏利多元回报债券型证券投资基金(以下简称“泰达宏利多元回报债券型基金”)，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是泰达宏利多元回报债券型基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>

审计意见段	我们认为，上述泰达宏利多元回报债券型基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了泰达宏利多元回报债券型基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	庞伊君
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	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	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利多元回报债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日
资产：	
银行存款	1,669,793.67
结算备付金	900,534.86
存出保证金	54,801.18
交易性金融资产	116,492,685.55
其中：股票投资	20,229,685.55
基金投资	-
债券投资	96,263,000.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	1,885,930.44
应收股利	-
应收申购款	600.00
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	121,004,345.70

负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	13,000,000.00
应付证券清算款	-
应付赎回款	5,050.91
应付管理人报酬	78,737.93
应付托管费	22,496.55
应付销售服务费	17,383.60
应付交易费用	183,215.14
应交税费	-
应付利息	10,440.44
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	272,000.00
负债合计	13,589,324.57
所有者权益:	
实收基金	106,006,955.47
未分配利润	1,408,065.66
所有者权益合计	107,415,021.13
负债和所有者权益总计	121,004,345.70

注:

1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日, 基金份额总额 106,006,955.47 份, 其中下属 A 类基金份额 56,577,441.08 份, C 类基金份额 49,429,514.39 份。下属 A 类基金份额净值 1.014 元, C 类基金份额净值 1.012 元。
2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体: 泰达宏利多元回报债券型证券投资基金

本报告期: 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	本期 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	7,598,340.81
1.利息收入	6,253,591.74

其中：存款利息收入	806,269.29
债券利息收入	4,986,039.76
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	461,282.69
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,526,174.87
其中：股票投资收益	1,578,811.38
基金投资收益	-
债券投资收益	792,623.20
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	154,740.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,208,712.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	27,286.88
减：二、费用	3,729,289.02
1. 管理人报酬	1,487,914.73
2. 托管费	425,118.51
3. 销售服务费	417,946.85
4. 交易费用	651,987.64
5. 利息支出	440,380.58
其中：卖出回购金融资产支出	440,380.58
6. 其他费用	305,940.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	3,869,051.79
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,869,051.79

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利多元回报债券型证券投资基金

本报告期：2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31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)	618,915,324.20	-	618,915,324.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	3,869,051.79	3,869,051.79
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)	-512,908,368.73	-2,460,986.13	-515,369,354.86
其中: 1. 基金申购款	24,062,513.15	559,504.09	24,622,017.24
2. 基金赎回款	-536,970,881.88	-3,020,490.22	-539,991,372.10
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)	106,006,955.47	1,408,065.66	107,415,021.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰达宏利多元回报债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2505号《关于核准泰达宏利多元回报债券型证券投资基金注册的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利多元回报债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集618,756,880.12元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第193号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利多元回报债券型证券投资基金基金合同》于2016年4月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为618,915,324.20份基金份额,其中认购资金利息折合158,444.08份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为中

国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《泰达宏利多元回报债券型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利多元回报债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据基金认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额(以下简称“多元回报 A”);从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为 C 类基金份额(以下简称“多元回报 C”)。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利多元回报债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债及分离交易可转债、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具等固定收益金融工具,股票、权证等权益类资产,以及经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的相关规定)。本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%,对权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%;现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中证全债指数收益率 X90%+中证红利指数收益率 X10%。

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 2017 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利多元回报债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 取得时发生的相关交易费用计入当期损益; 对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息, 单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红，基金份额持有人可对 A 类和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	1,669,793.67

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,669,793.67

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	20,658,309.57	20,229,685.55	-428,624.02
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	36,786,645.52	36,165,000.00
	银行间市场	60,256,443.14	60,098,000.00
	合计	97,043,088.66	96,263,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	117,701,398.23	116,492,685.55	-1,208,712.68

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未进行买断式逆回购交易。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	507.12
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	405.20

应收债券利息	1,884,993.52
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	24.60
合计	1,885,930.44

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	182,340.14
银行间市场应付交易费用	875.00
合计	183,215.14

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	272,000.00
合计	272,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰达多元回报债券 A		
项目	本期 2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	141,533,137.19	141,533,137.19
本期申购	2,136,445.15	2,136,445.15
本期赎回(以“-”号填列)	-87,092,141.26	-87,092,141.26
- 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	56,577,441.08	56,577,441.08

泰达多元回报债券 C		
项目	本期 2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	477,382,187.01	477,382,187.01
本期申购	21,926,068.00	21,926,068.00
本期赎回（以“-”号填列）	-449,878,740.62	-449,878,740.62
- 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	49,429,514.39	49,429,514.39

注：

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。
2. 本基金自 2016 年 3 月 14 日至 2016 年 4 月 8 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 618,756,880.12 元。根据《泰达宏利多元回报债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 158,444.08 元，在本基金成立后折算为 158,444.08 份基金份额，划入基金份额持有人账户。
3. 《泰达宏利多元回报债券型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 12 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务、转换业务和定期定额投资业务自 2016 年 6 月 13 日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

泰达多元回报债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,087,057.59	-307,740.00	1,779,317.59
本期基金份额交易产生的变动数	-1,000,733.83	14,480.42	-986,253.41
其中：基金申购款	15,446.68	3,683.87	19,130.55
基金赎回款	-1,016,180.51	10,796.55	-1,005,383.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,086,323.76	-293,259.58	793,064.18

泰达多元回报债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,990,706.88	-900,972.68	2,089,734.20
本期基金份额交易产生的变动数	-2,119,967.95	645,235.23	-1,474,732.72
其中：基金申购款	466,037.95	74,335.59	540,373.54
基金赎回款	-2,586,005.90	570,899.64	-2,015,106.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	870,738.93	-255,737.45	615,001.48

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	80,494.45
定期存款利息收入	679,000.01
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	45,433.88
其他	1,340.95
合计	806,269.29

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	203,380,875.34
减：卖出股票成本总额	201,802,063.96
买卖股票差价收入	1,578,811.38

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31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	792,623.20
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	792,623.20

7.4.7.13.2 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4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,015,909,143.51
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,006,287,323.93
减：应收利息总额	8,829,196.38
买卖债券差价收入	792,623.20

7.4.7.13.3 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。

7.4.7.13.4 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。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末有贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末有买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末未有贵金属投资赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末未有贵金属投资申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末未有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期末未有衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	154,740.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	154,740.29

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,208,712.68
——股票投资	-428,624.02
——债券投资	-780,088.66
——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	-1,208,712.68

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
----	---------------------------------------

基金赎回费收入	27,271.26
基金转换费收入	15.62
合计	27,286.88

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	640,562.64
银行间市场交易费用	11,425.00
合计	651,987.64

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	62,000.00
信息披露费	210,000.00
其他	400.00
账户维护费	12,000.00
银行费用	21,540.71
合计	305,940.71

7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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
宏利资产管理(香港)有限公司	基金管理人的股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行股票交易。

7.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行债券交易。

7.4.9.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行债券回购交易。

7.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行权证交易。

7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,487,914.73
其中：支付销售机构的客户维护费	428,101.04

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的 0.7% 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。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	425,118.51

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 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

7.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达多元回报债券 A	泰达多元回报债券 C	合计
中国银行	-	116,975.47	116,975.47
泰达宏利基金管理有限公司	-	45,632.22	45,632.22
合计	-	162,607.69	162,607.69

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.3% / 当年天数。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

7.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,669,793.67	211,161.12

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.10 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 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。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本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 13,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 4 日到期。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。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 20,229,685.55 元，属于第二层次的余额为 96,263,000.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	20,229,685.55	16.72
	其中：股票	20,229,685.55	16.72
2	固定收益投资	96,263,000.00	79.55
	其中：债券	96,263,000.00	79.55
	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	2,570,328.53	2.12
7	其他各项资产	1,941,331.62	1.60
8	合计	121,004,345.70	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	117,810.00	0.11
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,608,655.42	12.67

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,066,141.00	0.99
E	建筑业	585,869.13	0.55
F	批发和零售业	2,132,741.00	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	532,836.00	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	607,117.00	0.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,578,516.00	1.47
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	20,229,685.55	18.83

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600853	龙建股份	84,541	585,869.13	0.55
2	000521	美菱电器	83,100	575,052.00	0.54
3	002597	金禾实业	36,400	568,932.00	0.53
4	000889	茂业通信	37,200	568,044.00	0.53
5	600586	金晶科技	120,600	558,378.00	0.52
6	603306	华懋科技	15,300	556,767.00	0.52

7	300121	阳谷华泰	30,500	556,015.00	0.52
8	000910	大亚圣象	29,100	555,810.00	0.52
9	000789	万年青	69,200	555,676.00	0.52
10	002206	海利得	28,900	553,146.00	0.51

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002250	联化科技	6,221,200.00	5.79
2	000796	凯撒旅游	5,902,930.32	5.50
3	000800	一汽轿车	4,744,874.00	4.42
4	002344	海宁皮城	4,425,080.00	4.12
5	000591	太阳能	4,340,792.00	4.04
6	002587	奥拓电子	4,176,764.00	3.89
7	002573	清新环境	3,964,412.00	3.69
8	000776	广发证券	3,591,189.00	3.34
9	600389	江山股份	3,184,650.00	2.96
10	600153	建发股份	3,062,400.00	2.85
11	000402	金融街	2,869,500.00	2.67
12	601211	国泰君安	2,805,000.00	2.61
13	600030	中信证券	2,677,800.00	2.49
14	601288	农业银行	2,675,836.00	2.49
15	600584	长电科技	2,546,000.00	2.37
16	300387	富邦股份	2,534,400.00	2.36
17	002050	三花智控	2,272,386.00	2.12
18	601231	环旭电子	2,184,575.00	2.03
19	300498	温氏股份	2,180,834.60	2.03
20	002450	康得新	2,078,817.62	1.94

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。

8.4.2 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	002250	联化科技	6,295,081.45	5.86
2	000796	凯撒旅游	5,895,947.47	5.49
3	000800	一汽轿车	4,676,390.34	4.35
4	002344	海宁皮城	4,481,954.00	4.17
5	000591	太阳能	4,093,601.60	3.81
6	002587	奥拓电子	3,880,773.39	3.61
7	000776	广发证券	3,869,200.00	3.60
8	002573	清新环境	3,798,588.66	3.54
9	600389	江山股份	3,545,534.00	3.30
10	000402	金融街	3,016,500.00	2.81
11	600153	建发股份	2,882,510.71	2.68
12	600030	中信证券	2,808,456.00	2.61
13	601211	国泰君安	2,785,500.00	2.59
14	601288	农业银行	2,653,424.00	2.47
15	600584	长电科技	2,545,169.09	2.37
16	300387	富邦股份	2,495,564.38	2.32
17	002050	三花智控	2,340,000.00	2.18
18	300498	温氏股份	2,203,467.80	2.05
19	601231	环旭电子	2,187,000.00	2.04
20	603456	九洲药业	2,032,851.18	1.89

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。

8.4.3 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	222,460,373.53
卖出股票收入（成交）总额	203,380,875.34

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。

8.5 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	6,000,000.00	5.59

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	40,315,000.00	37.53
5	企业短期融资券	49,948,000.00	46.50
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	96,263,000.00	89.62

8.6 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	122395	15 富力债	100,000	10,246,000.00	9.54
2	1080004	10 郴州债	100,000	10,150,000.00	9.45
3	122366	14 武钢债	100,000	10,100,000.00	9.40
4	011699884	16 津旅游 SCP001	100,000	10,042,000.00	9.35
5	041653039	16 广新控股 CP001	100,000	10,000,000.00	9.31

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	54,801.18

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,885,930.44
5	应收申购款	600.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,941,331.62

8.12.4 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。

8.12.5 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的情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
泰达 多元 回报 债券 A	571	99,084.84	0.00	0.00%	56,577,441.08	100.00%
泰达 多元 回报 债券 C	324	152,560.23	0.00	0.00%	49,429,514.39	100.00%
合计	895	118,443.53	0.00	0.00%	106,006,955.47	100.00%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰达多元回报债券 A	1,323.35	0.0023%
	泰达多元回报债券 C	2,210.18	0.0045%
	合计	3,533.53	0.0033%

9.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰达多元回报债券 A	0
	泰达多元回报债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达多元回报债券 A	0
	泰达多元回报债券 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达多元回报债券 A	泰达多元回报债券 C
基金合同生效日（2016 年 4 月 13 日）基金份额总额	141,533,137.19	477,382,187.01
本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	2,136,445.15	21,926,068.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	87,092,141.26	449,878,740.62
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）	-	-
本报告期期末基金份额总额	56,577,441.08	49,429,514.39

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

11.2 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、2016 年 12 月，基金管理人职工代表大会决议公布：廖仁勇、葛文娜担任公司新一届监事会职工监事，王泉、邓艺颖不再担任职工监事。监事会其余成员保持不变。

2、2016 年 12 月，基金管理人股东会决议：刁锋担任公司新一届董事会董事，孙泉不再担任董事；张建强、查卡拉·西索瓦、樸睿波担任新一届董事会独立董事，汪丁丁、周小明、杜英华不再担任独立董事。董事会其余成员保持不变。

3、2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本年度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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为人民币 62,000 元，该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国金证券	1	108,850,906.62	25.56%	101,373.71	25.56%	-
方正证券	1	62,834,121.90	14.76%	58,517.54	14.76%	-
湘财证券	1	56,704,555.02	13.32%	52,808.85	13.32%	-
招商证券	1	52,509,042.71	12.33%	48,902.44	12.33%	-
渤海证券	1	37,210,923.68	8.74%	34,656.54	8.74%	-
中银国际	2	26,335,291.00	6.18%	24,525.84	6.18%	-
光大证券	1	21,883,086.26	5.14%	20,379.62	5.14%	-
中金公司	2	19,703,474.06	4.63%	18,349.76	4.63%	-
银河证券	2	18,298,310.69	4.30%	17,041.01	4.30%	-
东方财富	1	10,397,888.44	2.44%	9,683.63	2.44%	-
财富证券	2	7,903,130.49	1.86%	7,360.35	1.86%	-
华林证券	2	3,171,248.00	0.74%	2,953.43	0.74%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

江海证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：（一）2016 年本基金交易单元均为新增。

（二）交易单元选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- （1）经营规范，有较完备的内控制度；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要；
- （3）能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

11.7.2 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
国金证券	10,338,067.76	2.65%	13,000,000.00	0.21%	-	-
方正证券	-	-	10,000,000.00	0.16%	-	-
湘财证券	64,307,512.92	16.47%	165,600,000.00	2.63%	-	-
招商证券	6,804,520.00	1.74%	190,800,000.00	3.03%	-	-
渤海证券	1,022,120.00	0.26%	58,500,000.00	0.93%	-	-
中银国际	287,156,708.44	73.56%	5,571,500,000.00	88.54%	-	-
光大证券	6,036,532.71	1.55%	164,000,000.00	2.61%	-	-
中金公司	214,616.50	0.05%	5,000,000.00	0.08%	-	-
银河证券	14,464,420.27	3.71%	79,400,000.00	1.26%	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	34,500,000.00	0.55%	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

泰达宏利基金管理有限公司
2017年3月30日