

泰达宏利集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

本基金募集申请已于2008年7月18日获中国证监会证监许可『2008』955号文核准，基金合同于2008年9月26日正式生效。

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。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

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：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。

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，投资人在认购（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。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。

本更新招募说明书所载内容截止日为2019年09月26日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年06月30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

住所：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

办公地址：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

法定代表人：弓劲梅

组织形式：有限责任公司

信息披露联系人：聂志刚

联系电话：010-66577678

注册资本：一亿八千万元人民币

股权结构：天津市泰达国际控股（集团）有限公司：51%；宏利投资管理（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、泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利宏达混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基

金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创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、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利交利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利金利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利泽利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、泰达宏利年年添利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利鑫利半年定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利永利债券型证券投资基金、泰达宏利品牌升级混合型证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

（二）主要人员情况

1、董事会成员基本情况

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。

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。

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。

陈展宇先生，董事，拥有美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院经济学理学士学位，现任宏利资产管理（香港）有限公司亚洲区机构投资业务部主管，兼任北亚区财富及资产管理部主管（日本除外）。加入宏利前，陈展宇先生曾先后任职于怡富基金有限公司、时佳达投资管理（亚洲）有限公司、高盛（亚洲）资产管理部、源富资产管理（亚洲）有限公司等。陈先生持有特许金融分析师执照。

张凯女士，董事，拥有美国曼荷莲学院经济学学士、美国哥伦比亚大学工商管理硕士学位。现任中宏人寿保险有限公司首席执行官和总经理。出任现职前，张凯女士曾担任花旗中国副行长、零售金融业务总裁。加入花旗前，张凯女士曾担任麦肯锡管理咨询公司顾问以及华信惠悦咨询公司的精算分析师。张凯女士在北美和亚洲金融业拥有20多年的经验。

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。

樸睿波先生，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、监事会成员基本情况

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。

吴纪泽先生，监事。毕业于新南威尔士大学（澳大利亚悉尼），商学硕士（金融专业）。现任宏利资产管理公司（香港）北亚区投资业务部业务伙伴关系管理总监。曾任宏利投信（台湾）产品开发部襄理、宏利投信（台湾）产品开

发部副理、宏利资产管理公司（香港）北亚区投资业务部业务发展高级经理、业务伙伴关系管理副总监等职。加入宏利前，吴纪泽先生曾先后任职于台湾龙扬资产管理、台湾宝来金融集团、AIG投资管理等。吴纪泽先生在跨国资产管理公司和投资银行积累了十六年的跨境战略发展、产品开发与咨询以及市场研究经验。

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、人力资源部副总经理，自2019年7月起担任人力资源部总经理。

3、高级管理人员基本情况

弓劲梅女士，董事长。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；2019年6月起任公司副总经理兼财务总监、首席信息官；2019年8月起代理公司总经理，期限不超过90天。

刘晓玲女士，副总经理，毕业于河北大学，获经济学学士学位。2002年9月至2011年7月就职于博时基金管理有限公司，任零售业务部渠道总监；2011年7月至2013年9月任富国基金管理有限公司零售业务部负责人；2013年9月至2015年4月任泰康资产管理有限责任公司公募事业部市场总监；2015年4月加入融通基金管理有限公司，2015年9月至2018年7月任融通基金管理有限公司副总经理；2018年8月加入泰达宏利基金管理有限公司，2018年9月起任泰达宏利基金管理有限公司副总经理。

聂志刚先生，督察长。毕业于复旦大学，获经济学学士、法律硕士学位。2004年12月至2007年5月就职于中国证监会上海监管局；2007年5月至2010年5月任中银基金管理有限公司法律合规部部门总经理；2010年5月至2011年5月任富国基金管理有限公司监察稽核部部门总经理；2011年5月至2013年5月任中海

基金管理有限公司风险管理部部门总经理兼风控总监；2013年5月至2015年9月任太平洋保险集团有限公司集团审计中心投资条线首席审计师；2015年9月至2017年10月任银河期货有限公司首席风险官；2017年10月至2018年8月任天风期货股份有限公司首席风险官。2018年8月加入泰达宏利基金管理有限公司，2018年11月起任公司督察长。

4、本基金基金经理

丁宇佳女士: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，先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理，现任固定收益部总经理。2015年3月26日至今担任泰达宏利货币市场基金基金经理；2015年6月16日至今担任泰达宏利宏达混合型证券投资基金；2015年6月16日至今担任泰达宏利淘利债券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；2019年1月29日至今担任泰达宏利活期友货币市场基金基金经理；2019年1月31日至今担任泰达宏利年年添利定期开放债券型证券投资基金基金经理；2019年8月16日至今担任泰达宏利鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金经理。具备11年基金从业经验，11年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

刘洋先生:北京大学理学硕士；2015年1月至2015年4月任职于九坤投资（北京）有限公司，担任策略分析师；2015年5月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于金融工程部，先后担任助理研究员、研究员、基金经理助理等职务；2018年8月10日至今担任泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年1月9日至今担任泰达宏利量化增强股票型证券投资基金基金经理；2019年1月9日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；2019年1月9日至今担任泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金基金经理；2019年1月9日至今担任泰达宏利集利债券型证券投资基金基金经理；2019年1月9日至今担任泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金经理；2019年1月9日至今担任泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金基金经理；具备4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：自2008年9月至2011年9月由许杰先生担任基金经理。自2008年9月起至2012年9月由沈毅先生担任基金经理。自2013年5月起至2015年6月由熊壮先生担任基金经理。自2012年5月至2016年9月由卓若伟先生担任基金经理。自2016年9月至2019年1月由杨超先生担任基金经理。

5、投资决策委员会

投资决策委员会成员由公司代理总经理傅国庆、投资副总监戴洁、投资副总监刘欣、研究部总监张勋、固定收益部总经理丁宇佳、资深基金经理吴华、基金经理兼首席策略分析师庄腾飞、基金经理庞宝臣、基金经理傅浩、国际业务部总经理助理兼基金经理李安杰、信用研究部主管王龙组成。督察长聂志刚列席会议。

投资决策委员会根据决策事项，可分类为固定收益类事项、权益类事项、其它事项：

(1) 固定收益类事项由傅国庆、丁宇佳、庞宝臣、傅浩、李安杰、王龙表决。

(2) 权益类事项由戴洁、刘欣、张勋、吴华、庄腾飞表决。

(3) 其它事项由全体成员参与表决。

6、上述人员之间不存在亲属关系。

三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理本基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

-
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
 - 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
 - 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
 - 12、有关法律、行政法规和中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
- （3）承销证券；
- （4）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （5）从事可能使基金财产承担无限责任的投资；
- （6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- （4）在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- （7）违反法律法规的规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或泄露因职务便

利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

(9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(11) 贬损同行，以提高自己；

(12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(13) 以不正当手段谋求业务发展；

(14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

5、基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着勤勉谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

(3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

五、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

(2) 独立性原则：设立独立的监察稽核与风险管理部，监察稽核与风险管理部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；

(3) 相互制约原则：各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对内部控制负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

(1) 董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任；

(2) 督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；及时向董事会及/或董事会下设的相关专门委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

(3) 投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略；

(4) 风险控制委员会：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控；

(5) 监察稽核部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；

(6) 业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

3、内部控制的措施

(1) 建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新；

(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险；

(3) 建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险；

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：分别建立了公司营运风险和投资风险控制委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作和投资有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策；

(5) 建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

(6) 使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

(7) 提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

4、基金管理人关于内部控制制度的声明

(1) 基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

(2) 基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部合规控制。

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：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

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2019年6月30日，中国银行已托管716只证券投资基金，其中境内基金676只，QDII基金40只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF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。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

（一）销售机构及联系人

1. 直销机构

泰达宏利基金管理有限公司直销中心

住所：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

办公地址：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

联系人：郑小囡

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>

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/>

支持本公司旗下基金网上直销的银行卡和第三方支付有：中国银行卡、农业银行卡、建设银行卡、交通银行卡、招商银行卡、民生银行卡、兴业银行卡、中信银行卡、光大银行卡、浦发银行卡、广发银行卡和快钱支付。

（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. 代销机构

（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：刘连舸

客服电话：95566

联系人：崔瑛

银行网站：www.boc.cn

(2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：中国北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：陈四清

客服电话：95588

联系人：杨威

银行网站：www.icbc.com.cn

(3) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

客服电话：95533

联系人：王琳

银行网站：www.ccb.com

(4) 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

联系人：张伟

银行网站：www.abchina.com

(5) 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：彭纯

客服电话：95559

联系人：王菁

银行网址: www.bankcomm.com

(6) 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: 李建红

客服电话: 95555

联系人: 邓炯鹏

公司网站: www.cmbchina.com

(7) 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

公司网址: www.psbc.com

(8) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址: 上海市中山东一路12号

办公地址: 上海市中山东一路12号

法定代表人: 高国富

联系人: 肖武侠

客服电话: 95528

公司网址: www.spdb.com.cn

(9) 中信银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街9号

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人: 李庆平

客服电话: 95558

联系人: 王晓琳

网址: <http://bank.ecitic.com>

(10) 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：卢国锋

联系人：朱杰霞

客服电话：400-119-6228

公司网址：www.dongguanbank.cn

(11) 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

联系人：王宏

客户服务热线：95541

公司网站：www.cbhb.com.cn

(12) 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

联系人：胡技勋

客户服务热线：95574

公司网站：www.nbcb.com.cn

(13) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：李民吉

联系人：郑鹏

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(14) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：张东宁

客户服务电话：95526

联系人：盖君

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

（15）温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道196号

办公地址：温州市车站大道196号

法定代表人：邢增福

联系人：林波

客户服务热线：浙江省96699，上海962699，其他地区（0577）96699

公司网站：www.wzbank.cn

（16）天津银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区友谊路15号

办公地址：天津市河西区友谊路15号

法定代表人：李宗唐

联系人：李岩

客户服务电话：4006-960296

公司网站：www.bank-of-tianjin.com

（17）包商银行股份有限公司

注册地址：包头市青山区钢铁大街6号

办公地址：包头市青山区钢铁大街6号

法定代表人：李镇西

联系人：张建鑫

客服电话：95352

（18）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：谢永林

联系人：赵杨

客户服务电话：95511-3

公司网站：bank.pingan.com

（19）湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11层

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11层

法定代表人：孙永祥

客服电话：95351

联系人：李欣

公司网站：www.xcsc.com

（20）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：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.bhzq.com

（21）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2-6层

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或95551

联系人：辛国政

公司网站：www.chinastock.com.cn

（22）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、

42、43、44楼

法定代表人：孙树明

客服电话：95575或致电各地营业网点

联系人：黄岚

公司网站：www.gf.com.cn

（23）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：95587/4008-888-108

联系人：权唐

公司网站：www.csc108.com

（24）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：上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦

法定代表人：杨德红

客服电话：95521

联系人：芮敏祺

公司网站：www.gtja.com

（25）平安证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61-64层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61-64层

法定代表人：何之江

联系人：周一涵

全国免费业务咨询电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

（26）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼13层、21层-23层、25-29层、32

层、36层、39层、40层

法定代表人：潘鑫军

客服电话：95503

联系人：胡月茹

公司网站：www.dfzq.com.cn

（27）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层

法定代表人：李强

联系人：王雯

客服电话：4008323000

公司网站：www.csc.com.cn

（28）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

联系人：陈宇

客服电话：95523或400-889-5523

网址：www.swhysc.com

（29）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：李琦

联系人：陈宇

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

（30）中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市经七路86号

办公地址：上海市花园石桥路66号东亚银行金融大厦18层

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

客服电话：95538

网址：<http://www.zts.com.cn>

（31）中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦40层

法定代表人：许刚

客服电话：400-620-8888

联系人：王炜哲

公司网站：www.bocichina.com

（32）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

联系人：庞晓芸

公司网站：www.htsc.com.cn

（33）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：李福春

联系人：安岩岩

客户服务电话：95360

网址：www.nesc.cn

（34）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：何耀

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（35）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：叶顺德

联系人：田芳芳

客户服务电话：95399

公司网址：www.xsdzq.cn

（36）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：霍达

联系人：黄婵君

客户服务电话：95565，400-888-8111

公司网址：www.newone.com.cn

（37）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：丁益

联系人：金夏

客户服务电话：0755-33680000 400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

（38）南京证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭8号

办公地址：江苏省南京市江东中路389号

法定代表人：步国甸

联系人：王万君

客户服务电话：95386

公司网址：www.njzq.com.cn

（39）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：上海市浦东新区长柳路36号

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（40）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

联系人：金芸

客服电话：95553，400-8888-001

公司网站：www.htsec.com

（41）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：95396

联系人：梁微

网址：www.gzs.com.cn

（42）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）

联系人：王虹

公司网站：www.hfzq.com.cn

（43）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

联系人：周杨

公司网站：www.guosen.com.cn

（44）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：王作义

客户服务电话：4008-888-228

联系人：马贤清

网站：www.jyzq.cn

（45）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

联系人：朱磊

公司网站：www.tebon.com.cn

（46）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层、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层、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

网址：www.essence.com.cn

（47）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路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

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（48）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

客服电话：95317

网址：www.cfzq.com

（49）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

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：李新华

客户服务热线：95579或4008-888-999

联系人：奚博宇

长江证券客户服务网站：www.95579.com

（50）方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

公司地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层

法定代表人：高利

联系人：丁敏

客户服务热线：95571

网址: www.foundersc.com

(51) 民生证券股份有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

办公地址: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人: 余政

公司网址: www.msza.com

客服热线: 400-619-8888

(52) 国金证券股份有限公司

办公地址: 四川省成都市东城根上街95号

注册地址: 四川省成都市东城根上街95号

法定代表人: 冉云

客服电话: 95310

公司网址: www.gjzq.com.cn

联系人: 刘婧漪、贾鹏

(53) 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: 张佑君

联系人: 郑慧

公司网址: <http://www.cs.ecitic.com/newsite/>

客服热线: 95548

(54) 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: 上海市宛平南路88号金座

法定代表人: 陈宏

联系人: 周艳琼

公司网址: www.xzsec.com

客服热线: 95357

(55) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

办公地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

法定代表人：林炳城

联系人：罗艺琳

公司网址：www.zszq.com

客服热线：95329

（56）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：姜晓林

客服热线：95548

联系人：刘晓明

公司网址：<http://sd.citics.com/>

（57）万联证券股份有限公司

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13号高德置地广场E栋12层

法定代表人：张建军

联系人：甘蕾

公司网址：www.wlzq.com.cn

客服热线：400-888-8133

（58）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

法定代表人：廖庆轩

客服热线：400-809-6096、95355

联系人：周青

公司网址：www.swsc.com.cn

（59）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

联系人：李颖

公司网站：www.shhxzq.com

(60) 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

联系人：刘宏莹

公司网址：www.citicsf.com

客服电话：400-990-8826

(61) 诺亚正行基金销售有限公司

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：上海市杨浦区长阳路1687号2号楼

法定代表人：汪静波

公司网址：www.noah-fund.com

客服电话：400-821-5399

(62) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

(63) 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

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

（64）蚂蚁（杭州）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：www.fund123.cn

（65）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

（66）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张跃伟

客服电话：4008202899

公司网址：www.erichfund.com

（67）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

客服电话：400-920-0022

公司网址：<http://licaike.hexun.com/>

（68）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6层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-818-8000

公司网址：www.myfund.com

(69) 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

客服电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

(70) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司

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

办公地址：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

客服电话：400-001-1566

公司网址：www.yilucaifu.com

(71) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元

办公地址：上海市徐汇区宜山路700号普天信息产业园2期C5栋2楼

法定代表人：金佶

客服电话：021-34013996

公司网址：[https:// www.hotjijin.com](https://www.hotjijin.com)

(72) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：王之光

客服电话：400-821-9031

公司网址：www.lufunds.com

(73) 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

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室

法定代表人：周斌

客服电话：400-8980-618

公司网址：www.chtwm.com

（74）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座6层

法定代表人：马勇

客服电话：400-166-1188

公司网址：<http://8.jrj.com.cn/>

（75）上海联泰基金销售有限公司

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

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：燕斌

客服电话：400-166-6788

公司网址：www.66zichan.com

（76）北京广源达信基金销售有限公司

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

客服电话：400-623-6060

公司网址：<http://www.niuniufund.com>

（77）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泛海国际SOHO城（一期）2301室

办公地址：湖北省武汉市江汉区台北一路环亚大厦B座6楼

法定代表人：陶捷

客服电话：4000279899

公司网址：www.buyfunds.cn

(78) 北京晟视天下基金销售有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

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

法定代表人：蒋煜

客服电话：010-58170761

公司网址：www.shengshiview.com

(79) 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

办公地址：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

客服电话：4001599288

公司网址：<https://danjuanapp.com/>

(80) 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

办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C座

法定代表人：赵芯蕊

客服电话：010-62675369

公司网址：<http://www.xincai.com/>

(81) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东路1号保利国际广场南塔1201-1203室

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

(82) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1138号

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

公司网址：www.hcjjjin.com

(83) 上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢
1层103-1、103-2办公区

办公地址：上海市浦东新区新金桥水路27号1号楼

法定代表人：冯轶明

客服电话：400-820-1515

公司网址：www.zhengtongfunds.com

(84) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人：王廷富

客服电话：4007991888

公司网址：www.520fund.com.cn

(85) 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：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

(86) 北京肯特瑞基金销售有限公司

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：江卉

客服电话：95518/4000888816

公司网址：http://fund.jd.com

(87) 北京格上富信基金销售有限公司

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

客服电话：400-066-8586

公司网址：www.igesafe.com

（88）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：4000411001

公司网址：www.taichengcaifu.com

（89）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场53楼

法定代表人：李兴春

客服电话：4009217755

公司网址：www.leadfund.com.cn

（90）中宏人寿保险有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道88号金茂大厦6楼

办公地址：上海市虹口区西江湾路388号凯德龙之梦虹口广场B栋11层

法定代表人：何达德（Michael Edward Huddart）

客服电话：95383

公司网址：<https://funds.manulife-sinochem.com/>

（91）济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

法定代表人：杨健

客服电话：400-673-7010

公司网址：www.jianfortune.com

(92) 万家财富基金销售（天津）有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓
2-2413

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层

法定代表人：李修辞

客服电话：010-59013825

公司网址：www.wanjiawealth.com

(93) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号楼soho现代城C座18层1809

法定代表人：戎兵

客服电话：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

(94) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人：李科

客服电话：95510

公司网址：<http://fund.sinosig.com/>

(95) 北京辉腾汇富基金销售有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号2-2-1

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B

法定代表人：许宁

客服电话：400-829-1218

公司网址：www.htfund.com

(96) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室

法定代表人：吴言林

客服电话：025-56663409

公司网址：www.huilinbd.com

（97）北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101

办公地址：北京市海淀区上地信息路甲9号奎科科技大厦

法定代表人：张旭阳

客服电话：95055-4

公司网址：www.baiyingfund.com

（98）嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层
5312-15单元

办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

公司网址：www.harvestwm.cn

（99）深圳盈信基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1

办公地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1

法定代表人：苗宏升

客服电话：4007903688

公司网址：<http://www.fundying.com/>

（100）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室

法定代表人：冷飞

客服电话：400-711-8718

公司网址：www.wacaijijin.com

（101）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-819-9868

公司网址：<https://www.tdyhfund.com>

（102）海银基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室

办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼

法定代表人：惠晓川

客服电话：400-808-1016

公司网址：www.fundhaiyin.com

（103）奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海
商务秘书有限公司

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客服电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（104）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：王锋

客服电话：95177

公司网址：www.snjijin.com

（105）上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

法定代表人：黄欣

客服电话：400-6767-523（021-33635338）

公司网址：www.zhongzhengfund.com

(二) 注册登记机构

名称：泰达宏利基金管理有限公司

住所：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

办公地址：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

法定代表人：弓劲梅

联系人：石楠

联系电话：010-66577769

传真：010-66577750

(三) 律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

经办律师：梁丽金、刘佳

(四) 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)

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507
单元01室

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心
11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：魏佳亮

经办注册会计师：单峰、魏佳亮

四、基金的名称

泰达宏利集利债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

在有效控制风险及保持流动性基础上，力求实现基金财产稳定的当期收益和长期增值的综合目标。

七、基金的投资方向

本基金投资范围包括：国债、央行票据、金融债、企业（公司）债、资产支持证券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券，下同）、债券回购等固定收益类金融工具，以及股票、权证等权益类品种和法律法规及中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。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。

本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，在一般情况下，基金资产将主要投资于企业（公司）债、金融债、可转换债券、国债及央行票据等。投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%，其中包括参与一级市场新股申购、投资二级市场股票、持有可转换公司债券转股后所得股票以及权证等。基金持有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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资策略

1. 战略性资产配置策略，确定债券股票配置比例

本基金以债券投资为主，最低为80%，股票等权益类资产投资比例最高为20%，最低为0%，并保持现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，以符合基金资产流动性的要求。

投资组合的资产分配是基于对未来市场的信心程度，根据信心度对风险进行预估和分配，从而决定资产的分配。对市场信心程度的判断将以MVPS模型为基础，通过召开投资决策委员会，形成MVPS的评分，从而确定基金中各类资产的配置比例范围。

本基金将使用成功运用的MVPS模型来进行资产配置调整。MVPS模型主要考虑M（宏观经济环境）、V（价值）、P（政策）、S（市场气氛）四方面因素，具体因素如下：

Macro 宏观经济	Valuation 价值	Policy 国家政策	Sentiment 市场气氛
GDP 增幅	市场整体的P/B, P/E运	国家宏观经济政策和监管	QFII 申请
固定资产投资	行区间	政策对资本市场下一阶段	分析师指数
工业企业利润增长率	估值的国际比较, 包括	的影响:	开放式基金的平均仓位
居民消费价格指数 CPI	P/E, P/B, EV/EBITDA,	政策的持续性和贯彻情况	测算
利率和利率政策	市值, 长期成长性等方		基金募集规模
M2 增长率	面的比较		技术分析指标
国际经济环境			市场流动性
财政货币政策			市场关注焦点分析

MVPS模型作为本基金管理人持续一致的资产配置工具，通过定量和定性分析的有效结合判断未来市场的发展趋势，为本基金的资产配置提供支持。

①M—宏观经济环境（MacroEnvironment）

研究分析的主要指标包括

GDP增幅

固定资产投资

工业企业利润增长率

货币供应量M2的增长等等

②V-价值 (Valuation)

P/B、P/E运行模型

我们衡量市场整体价值的主要标准是P/B和P/E，这两个指标有其自身的运行规律，都有价值回归的特征。当市场偏离真实价值太远时，都会有回归的趋势。现实中我们总是无法准确判断市场的真实价值是多少，而只能尝试用各种模型来描述其运行轨迹。通过实证分析，我们运用的P/B、P/E运行模型能基本显示市场的重要拐点。

公司治理结构

公司治理结构是影响证券市场发展的长期因素，这一因素虽然很难用具体指标来量化，但它的完善和提高，能促进企业的良性运作，最终在业绩和市场形象中得到体现。

③P-政策 (Policy)

国家宏观经济政策和监管政策对证券市场下一阶段的发展具有重要影响作用。

④S-气氛 (Sentiment)

市场气氛是证券市场政策发挥作用的土壤。在短期内，市场气氛是决定国家政策，甚至宏观政策变化在证券市场中能否得到体现的重要基础。

保证金：代表投资者对股票市场未来趋势的看法。

分析师指数：反映了市场上大多数分析师对市场的看法，能体现一定市场气氛。

基金仓位：基金逐渐成为市场上的一支有代表性的机构投资者队伍，其对股票的持仓比例反映了对市场的预期。

市场的特殊效应：每个市场都会因为自身的特殊性而反映出一定的效应。

投资决策委员会将每月召开例会，研究部将对以上各层面提供分析报告，

为投资决策会提供参考依据，会议将形成对MVPS的评分，从而确定基金中各类资产的配置比例范围。

2. 债券投资策略

对于债券投资组合构建，本基金管理人将充分发挥在研究能力方面的优势，进行积极主动式的管理，采用“自上而下”的方式结合我公司成功运用的MVPS模型辅助市场利率预期分析、信用分析、流动性分析和敏感性分析并获得债券类属价值判断和类属配置比例，同时，结合类属价值判断运用“自下而上”的定量及定性的方法对个券进行信用分析、久期及凸性分析、收益率分析、相对价值分析和税收因素分析，根据分析结果挑选出优质个券，最后根据类属配置比例构建债券投资组合。通过综合运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、品质互换、回购套利等策略提高债券组合回报水平。

（1）利率预期分析策略

固定收益研究小组根据本公司成功运用的MVPS模型对影响债券投资的宏观经济状况、货币政策、市场环境等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平。

（2）凸性挖掘策略

结合债券市场期限结构的历史数据、新债发行、回购及市场拆借利率，形成对收益率曲线形状变化的预期判断，当收益率曲线凸度价值被低估时采取相应的“哑铃”策略，高估时采取“子弹”策略或合理时的梯形策略已获得由收益率曲线变形得来的投资收益。

（3）信用分析策略

借助本基金管理人在股票市场中专业的研究能力，对发债企业进行深入的信用及财务分析，分析内容及指标包括：

- 短期偿债能力分析：流动比率、速动比率、现金比率、利息保证倍数等。
- 长期偿债能力分析：有形资产负债率等。
- 盈利能力分析：主营业务利润率、营业利润率等。
- 营运能力分析：应收帐款周转率、存货周转率、应付帐款周转率等。

- 现金流量分析：短期债务偿还比率、长期债务偿还比率、现金流量资产利润率、现金流量利润率、经营指数等。

根据对债券发行人的基本面研究及上面的信用财务分析确定债券发行人及其所在行业的信用风险利差水平，并通过市场风险偏好变化导致的信用利差变化和定价偏差获得相对回报。

（4）波动性交易策略

对于内含赎回或回售选择权的债券和可转换为股本选择权的可转换公司债券，金融工程小组将对其所隐含的期权进行合理定价，并根据其价格的波动水平获得该债券的期权调整利差，并以此作为该债券投资估值的主要依据。

3. 股票投资策略

（1）新股申购策略

本基金将研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面，根据股票市场整体定价水平，发行折价水平及一、二级市场间资金供求关系，制定相应的新股认购策略。对通过新股申购获得的股票，将根据其实际的投资价值确定持有或卖出。

（2）二级市场股票投资策略

对于股票投资组合，本基金将主要关注具有持续分红特征的优质上市公司，在符合基金整体资产配置及本基金整体投资风格的前提下，采用“自下而上”的个股精选策略。

本基金股票投资部分将重点投资于具有持续分红特征的股票，该类股票一般是指具有良好稳定的分红政策和意愿、持续良好的盈利及分红能力的上市公司。在筛选该类股票时采取以下策略：

- 在公司股票池中选取现金股息率（税后） >0 的上市公司；
- 在此基础上筛选出预期未来3年连续税后分红 >0 的上市公司形成备选库；

- 最后结合“行业文档”分析方法及ROA和ROE指标对备选库中股票深入分析，通过对盈利水平、现金流状况、股息率、P/E、P/B、持续分红潜力和分红意愿的重点研究及实地考察精选出股息率高、分红稳定且在行业中具有相对优势的优质上市公司股票。

4、权证投资策略

本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下，本着谨慎可控的原则，进行权证投资。

依据现代金融投资理论，计算权证的理论价值，结合对权证标的证券的基本面进行分析，评估权证投资价值；同时结合对未来走势的判断，充分考虑权证的风险和收益特征，在严格控制风险的前提下，谨慎投资。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准： $90\% \times$ 上证国债指数收益率 $+10\% \times$ 中证红利指数收益率。

本基金采用上证国债指数及中证红利指数衡量基金的投资业绩，其主要原因如下：

上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。

中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市、现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的股票作为样本股，能综合反映沪深证券市场高股息股票的整体状况和走势。

随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

十、基金的风险收益特征

本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2019年10月18日复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告所载数据截止2019年06月30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	226,166,269.91	11.56
	其中：股票	226,166,269.91	11.56
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,665,828,057.94	85.17
	其中：债券	1,665,828,057.94	85.17
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买 入返售金融资产	—	—

7	银行存款和结算备付金 合计	36,871,856.10	1.89
8	其他资产	26,981,171.23	1.38
9	合计	1,955,847,355.18	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

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	2,715,258.00	0.15
B	采矿业	5,377,064.00	0.30
C	制造业	100,583,864.46	5.67
D	电力、热力、燃气及水生 产和供应业	4,403,713.00	0.25
E	建筑业	5,652,347.48	0.32
F	批发和零售业	17,937,332.40	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,563,012.32	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技 术服务业	13,435,596.53	0.76
J	金融业	45,283,968.40	2.55
K	房地产业	12,791,450.44	0.72
L	租赁和商务服务业	5,542,445.00	0.31

M	科学研究和技术服务业	1,896,596.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管 理业	802,142.00	0.05
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	2,924,514.88	0.16
S	综合	3,256,965.00	0.18
	合计	226,166,269.91	12.75

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明 细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	601318	中国平安	96,200	8,524,282.00	0.48
2	000651	格力电器	106,300	5,846,500.00	0.33
3	600016	民生银行	855,160	5,430,266.00	0.31
4	600887	伊利股份	161,600	5,399,056.00	0.30
5	600519	贵州茅台	4,800	4,723,200.00	0.27
6	600030	中信证券	186,800	4,447,708.00	0.25

7	600036	招商银行	105,400	3,792,292.00	0.21
8	600919	江苏银行	508,500	3,691,710.00	0.21
9	601555	东吴证券	349,300	3,580,325.00	0.20
10	600031	三一重工	273,600	3,578,688.00	0.20

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	583,173,706.00	32.88
	其中：政策性金融债	532,913,706.00	30.05
4	企业债券	298,778,000.00	16.85
5	企业短期融资券	402,202,000.00	22.68
6	中期票据	215,281,000.00	12.14
7	可转债（可交换债）	60,066,351.94	3.39
8	同业存单	106,327,000.00	5.99
9	其他	—	—
10	合计	1,665,828,057.94	93.92

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	180204	18 国开 04	1,500,000	156,735,000.00	8.84
2	180214	18 国开 14	1,000,000	102,340,000.00	5.77
3	180208	18 国开 08	1,000,000	101,760,000.00	5.74
4	041800426	18 鞍钢 CP005	1,000,000	100,780,000.00	5.68
5	011802315	18 金地 SCP003	1,000,000	100,660,000.00	5.68

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

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。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的民生银行（600016）2018年11月9日被银保监会做出行政处罚决定。民生银行因（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）同业投资违规接受担保；（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）个人理财资金违规投资；（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；（七）为非保本理财产品提供保本承诺；（八）贷款业务严重违反审慎经营规则。共罚款3360万元。

基金管理人分析认为，本基金权益部分是以中证红利指数收益率作为业绩比较基准，民生银行作为高股息率股票是业绩比较基准重要成份股，考虑到其高分红的投资价值，基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其的投资。

本基金投资的其余证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	96,053.44
2	应收证券清算款	946,221.07
3	应收股利	-
4	应收利息	25,927,404.22
5	应收申购款	11,492.50
6	其他应收款	-

7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	26,981,171.23

10.4 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	113011	光大转债	26,043,100.00	1.47
2	127005	长证转债	16,319,313.84	0.92
3	132015	18中油EB	14,683,500.00	0.83

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

10.6 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。

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2008年9月26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) 历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较（截止到2019年6月30日）

泰达宏利集利债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2008. 9. 26~2008. 12. 31	3. 94%	0. 12%	1. 75%	0. 29%	2. 19%	-0. 17%
2009. 1. 1~2009. 12. 31	0. 31%	0. 18%	9. 12%	0. 23%	-8. 81%	-0. 05%
2010. 1. 1~2010. 12. 31	3. 94%	0. 23%	1. 69%	0. 16%	2. 25%	0. 07%
2011. 1. 1~2011. 12. 31	-4. 47%	0. 31%	1. 06%	0. 13%	-5. 53%	0. 18%

2012. 1. 1~2012. 12. 31	7. 71%	0. 12%	3. 88%	0. 12%	3. 83%	0. 00%
2013. 1. 1~2013. 12. 31	-0. 03%	0. 15%	1. 62%	0. 16%	-1. 65%	-0. 01%
2014. 1. 1~2014. 12. 31	30. 50%	0. 40%	8. 55%	0. 12%	21. 95%	0. 28%
2015. 1. 1~2015. 12. 31	23. 90%	0. 68%	8. 84%	0. 27%	15. 06%	0. 41%
2016. 1. 1~2016. 12. 31	-2. 90%	0. 26%	2. 46%	0. 15%	-5. 36%	0. 11%
2017. 1. 1~2017. 12. 31	3. 13%	0. 16%	2. 28%	0. 07%	0. 85%	0. 09%
2018. 1. 1~2018. 12. 31	-1. 14%	0. 23%	2. 99%	0. 12%	-4. 13%	0. 11%
2019. 1. 1~2019. 6. 30	6. 37%	0. 25%	3. 34%	0. 14%	3. 03%	0. 11%
合同生效以来至 2019. 6. 30	89. 82%	0. 31%	58. 74%	0. 17%	31. 08%	0. 14%

泰达宏利集利债券C

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

		差②	③	④		
2008.9.26~2008.12.31	3.86%	0.12%	1.75%	0.29%	2.11%	-0.17%
2009.1.1~2009.12.31	-0.13%	0.18%	9.12%	0.23%	-9.25%	-0.05%
2010.1.1~2010.12.31	3.47%	0.23%	1.69%	0.16%	1.78%	0.07%
2011.1.1~2011.12.31	-4.98%	0.31%	1.06%	0.13%	-6.04%	0.18%
2012.1.1~2012.12.31	7.24%	0.12%	3.88%	0.12%	3.36%	0.00%
2013.1.1~2013.12.31	-0.52%	0.15%	1.62%	0.16%	-2.14%	-0.01%
2014.1.1~2014.12.31	29.91%	0.40%	8.55%	0.12%	21.36%	0.28%
2015.1.1~2015.12.31	23.41%	0.68%	8.84%	0.27%	14.57%	0.41%
2016.1.1~2016.12.31	-3.20%	0.27%	2.46%	0.15%	-5.66%	0.12%
2017.1.1~2017.12.31	2.91%	0.16%	2.28%	0.07%	0.63%	0.09%
2018.1.1~2018.12.31	-1.52%	0.23%	2.99%	0.12%	-4.51%	0.11%
2019.1.1~2019.6.30	6.15%	0.26%	3.34%	0.14%	2.81%	0.12%
合同生效以来至 2019.6.30	81.63%	0.31%	58.74%	0.17%	22.89%	0.14%

注：集利债券基金业绩比较基准： $90\% \times$ 上证国债指数收益率 $+10\% \times$ 中证红利指数收益率

本基金采用上证国债指数及中证红利指数衡量基金的投资业绩，其主要原因如下：

上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。

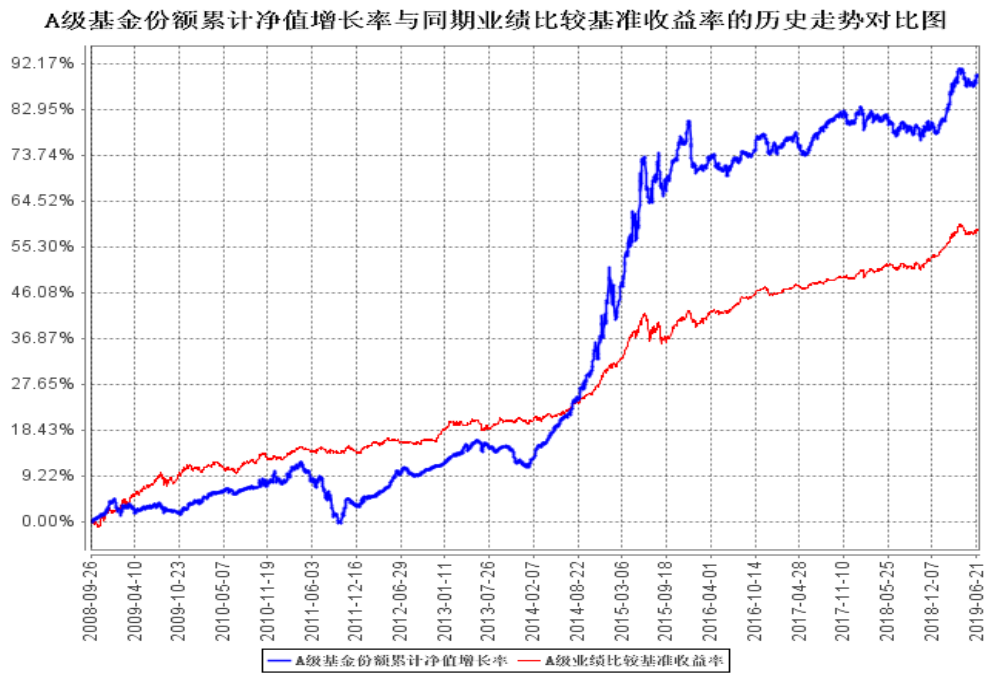
中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市、现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的股票作为样本股，综合反映沪深证券市场高股息股票的整体状况和走势。

(二) 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

泰达宏利集利债券型基金累计份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

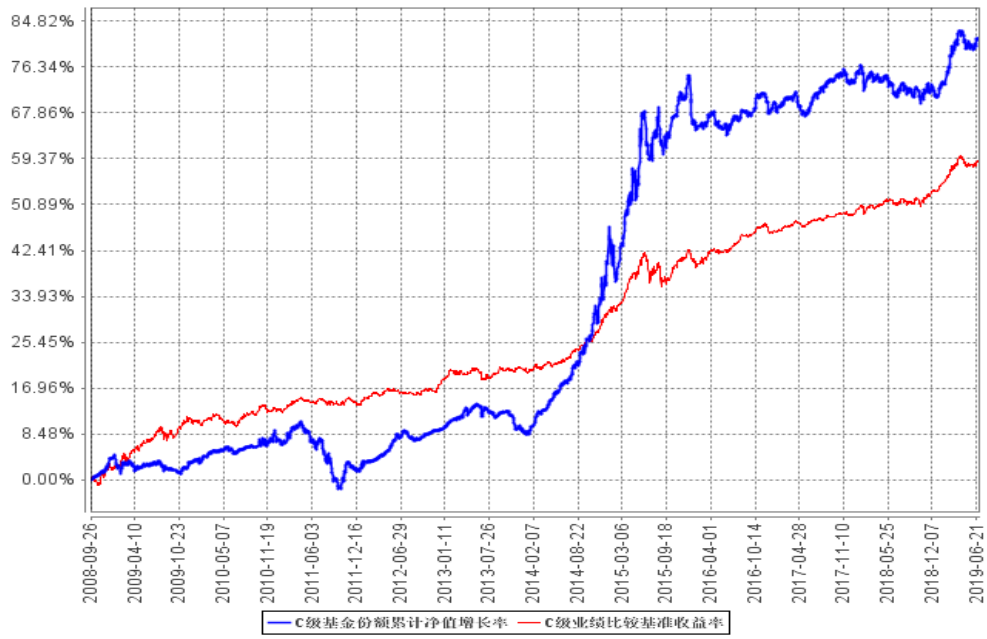
(2008年9月26日至2019年6月30日)

泰达宏利集利债券A:



泰达宏利集利债券C:

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



注：本基金在建仓期结束和本报告期末各项投资比例符合基金合同约定的各项比例要求。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

基金管理人的管理费；

基金托管人的托管费；

销售服务费；

4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；

5、基金合同生效以后的信息披露费用；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；

8、基金的资金汇划费用；

9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%的年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，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：

$$H=E\times\text{年托管费率}\div\text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(3) 除管理费和托管费之外的基金费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

(1) 申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。

(2) 赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。

(3) 销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times\text{年销售服务费费率}\div\text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C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、休息日等，支付日期顺延。

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。

(三) 不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效前所发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用，不得从基金财产中列支。

（四）基金管理费、托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况协商调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率或改变收费模式。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率或不提高整体费率水平的情况下改变收费模式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

基金管理人必须最迟于新的费率或收费模式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

（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）“三、基金管理人”中对基金管理人概况、董事会成员、监事会成员、投资决策委员会成员名单内容部分进行了变更。

（三）更新了“四、基金托管人”中的内容。

（四）“五、相关服务机构”部分对直销机构及网上直销系统、代销机构、注册登记机构、会计师事务所信息进行了变更。

（五）“九、基金的投资”部分对投资组合报告内容更新至2019年6月30日。

（六）“十、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2019年6月30日，并更新了历史走势对比图。

（七）更新了“十九、基金合同的内容摘要”中的内容。

（八）更新了“二十、基金托管协议的内容摘要”中的内容。

（九）更新了“二十二、其他应披露事项”中的内容。

泰达宏利基金管理有限公司

2019年11月09日