

# 泰达宏利收益增强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】

泰达宏利收益增强债券型证券投资基金（以下简称本基金）转型自泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金（以下简称原基金），原基金于2013年4月26日经中国证监会证监许可[2013]608号文注册；原基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于2015年8月6日表决通过了《关于泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，于2015年9月9日实施基金转型，自基金转型实施日起，由《泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《泰达宏利收益增强债券型证券投资基金基金合同》生效，原《泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

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。

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，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、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。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2017年3月9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。

## 第1部分 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、泰达宏利启迪灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启慧灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启泽灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启明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

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。

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

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，从事财务管理和企业管理咨询工作。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

庞宝臣先生，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10日加入泰达宏利基金管理有限公司，曾任固定收益部基金经理助理一职，现任基金经理；2016年7月22日至今担任泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2016年8月5日至今担任泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年8月5日至今担任泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年8月5日至今担任泰达宏利瑞利分级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增利灵活配置定期开放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定宏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多元回报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汇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收益增强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溢利债券型证券投资基金基金经理；2017年3月1日至今担任泰达宏利启迪灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年3月1日至今担任泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金基金经理；11年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

杨超先生。数学与金融计算硕士，基金经理；2010年5月加入建信基金管



理有限公司，从事金融工程等工作，历任投资管理部助理研究员、初级研究员、基金经理助理等职务；2014年6月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理助理，现任基金经理；2014年10月13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；2014年10月13日至今担任泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金经理；2015年11月20日至今担任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基金经理；2016年8月30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；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26日至今担任泰达宏利收益增强债券型证券投资基金基金经理；2016年12月27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；备7年证券基金从业经验，7年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

历任基金经理：卓若伟先生2013年6月至2016年9月管理本基金。李慧鹏先生2014年2月至2015年4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。

#### 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。

## 第2部分 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。

#### **（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。2016 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。

## 第3部分 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、010-66577619、

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

交易系统网址：<https://etrade.mfcteda.com/etrading/>

支持基金管理人旗下基金网上直销的银行卡和第三方支付有：农行卡、建行卡、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、广发银行卡和汇付天下“天天盈”、快钱支付账户等。

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“天天盈”账户和快钱支付账户。

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) 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

6) 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

7) 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

8) 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

电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

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](http://www.wzbank.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](http://bank.pingan.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

电话：0769-22119061

传真：0769-22117730

联系人：陈幸

客服电话：4001196228

公司网址：[www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn)

11) 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](http://www.nbc.com.cn)

12) 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  
法定代表人：李镇西  
成立时间：1998年12月16日  
注册资本：391173.904万元人民币  
企业类型：股份有限公司  
营业期限：永续经营  
电话：010-64816038  
传真：010-84596546

13) 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：林俊波  
客服电话：400-888-1551  
传真：021-68865680  
公司网站：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

14) 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

15) 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

16) 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

17) 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](http://www.gf.com.cn)

18) 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](http://www.csc108.com)

19) 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

传真：0755-82400862

网址：[www.PINGAN.com](http://www.PINGAN.com)

20) 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：95521

联系人：芮敏祺

公司网站：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

21) 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：姜昧军

联系人：袁媛

客服电话：0755-83199511

公司网站：[www.cscoc.com.cn](http://www.cscoc.com.cn)

22) 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](http://www.swhysc.com)

23) 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](http://www.zts.com.cn)

24) 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](http://www.nesc.cn)

25) 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](http://www.ebscn.com)

26) 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](http://www.xsdzq.cn)

27) 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](http://www.newone.com.cn)



28) 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](http://www.cgws.com)

29) 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：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

联系人：潘月

联系电话：025-52310569

客户服务电话：400-828-5888

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

30) 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](http://www.xyzq.com.cn)

31) 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

### 32) 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

### 33) 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

### 34) 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

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

公司网站：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

35) 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](http://www.jyzq.cn)

36) 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](http://www.tebon.com.cn)

37) 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

联系电话：0755-82825551

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

38) 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 楼

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](http://www.longone.com.cn)

客服电话：95531，400-888-8588

39) 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](http://www.guodu.com)

40) 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](http://www.cfzq.com)

41) 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](http://www.hysec.com)

42) 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](http://www.95579.com)

43) 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：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：雷杰

客户服务热线：95571

网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

44) 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

法定代表人：冉云

客服电话：95310

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

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

#### 45) 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](http://www.citics.com)

客服热线：95548

#### 46) 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](http://www.xzsec.com)

客服热线：400-911-2233

#### 47) 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发展大楼7层、8层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、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](http://www.zszq.com)

客服热线：400-102-2011

48) 九州证券股份有限公司

注册地址：西宁市城中区西大街 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](http://www.jzsec.com)

客服热线：400-654-3218

49) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省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](http://www.jhzq.com.cn)

客服热线：400-666-2288

50) 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](http://www.citicssd.com)

客服热线：95548

51) 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](http://www.swsc.com.cn)

客服热线：400-809-6096

52) 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](http://www.shhxzq.com)

53) 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](http://www.citicsf.com)

客服电话：400-990-8826

54) 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](http://www.zlfund.cn)；[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

客服热线：4006-788-887

55) 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](http://www.ehowbuy.com)

客服热线： 400-700-9665

56) 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

网址： <http://www.fund123.cn/>

57) 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

公司网站： [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

58) 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

公司网站： [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

59) 北京展恒基金销售有限公司

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](http://www.myfund.com)

60) 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](http://www.5ifund.com)

61) 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](http://www.yilucaifu.com)

62) 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>

63) 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](http://www.lufunds.com)

64) 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](http://www.chtfund.com)

65) 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](http://www.noah-fund.com)

客服热线：400-821-5399

66) 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>

67) 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](http://www.jincheng-fund.com)

68) 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>

69) 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>

70) 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

71) 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

72)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号泛利大厦10层

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

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](http://licaike.hexun.com)

73)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

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 d 座 21 层&28 层

法定代表人：蒋煜

传真：010-58100800

客户服务电话：400-818-8866

网址：[www.gscaifu.com](http://www.gscaifu.com)

74)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](http://www.ncfjj.com)

75)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/>

#### 76) 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](http://www.yingmi.cn)

#### 77) 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  
和经济展发区）

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](http://www.jiyufund.com.cn)

#### 78) 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](http://www.fundzone.cn)

79) 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](http://www.zhengtongfunds.com)

80) 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

81) 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>

82) 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

客服热线：400-111-0889

### 83) 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

### 84) 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：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、孙睿

联系人：孙睿

（四）审计基金财产的会计师事务所

法定名称：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

电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：单峰、庞伊君

联系人：庞伊君

## 第4部分 基金的名称

泰达宏利收益增强债券型证券投资基金

## 第5部分 基金的类型

契约型开放式

## 第6部分 基金的投资目标

紧跟新常态下我国经济发展过程中的经济调控政策，灵活配置各类投资工具，力争为投资者创造显著超越业绩比较基准的投资收益。

## 第7部分 基金的投资范围

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）。

本基金可持有可转债转股所得的股票、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，也可直接从二级市场上买入股票和权证。

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。

基金的投资组合比例为：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%

## 第8部分 基金的投资策略

### 1、资产配置策略

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。

### 2、债券投资策略

#### （1）久期管理策略

在全球经济的框架下，本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化做出判断，密切跟踪 CPI、PPI、汇率、M2 等利率敏感指标，运用数量化工具，对未来市场利率趋势进行分析与预测，并据此确定合理的债券组合目标久期，通过合理的久期控制实现对利率风险的有效管理。

#### （2）债券的类属配置

本基金定性和定量地分析不同类属债券类资产的信用风险、流动性风险及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力，通过比较或合理预期不同类属债券类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整不同类属债券类资产间的配置比例。

#### （3）收益率曲线配置策略

本基金将通过预期收益率曲线形态变化来调整投资组合的头寸。

在考察收益率曲线的基础上，本基金将确定采用子弹策略、哑铃策略或梯形策略等，以从收益率曲线的形变中获利。一般而言，当收益率曲线变陡时，将采用子弹策略；当收益率曲线变平时，将采用哑铃策略；在预期收益率曲线不变或平行移动时，则采用梯形策略。

#### （4）杠杆放大策略

当回购利率低于债券收益率时，本基金将实施正回购融入资金并投资于信用债券等可投资标的，从而获取收益率超出回购资金成本（即回购利率）的套利价值。

#### （5）信用债券投资策略

发债主体的信用风险评级对于信用债券投资至关重要。本基金的信用风险评

级主要依靠本基金管理人设立的独立的评级系统，辅以信用评级机构提供的债项评级和主体评级的结果。按照发债主体的不同，信用债券分为产业债和城投债，根据两类债券的特点，分别采用不同的评级系统，并给予不同的信用评级。

依据信用债券评级结果、债券品种、息票率、剩余期限、流动性、交易市场、收益率等因素，结合不同品种的收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型，决定是否将个债纳入组合及其投资数量。在有效控制信用风险的前提下，重点关注信用状况正在改善的发债主体，选择具有以下特征的债券：所属行业处于上升周期、具有强大的股东背景、较高到期收益率、较高当期收入、价值被低估、属于创新品种而价值尚未被市场充分发现。

#### （6）特殊固定收益品种投资策略

##### 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。

##### 3、股票投资策略

本基金针对沪深两市，剔除其中不符合投资要求的股票（包括但不限于法律法规或公司制度明确禁止投资的股票、涉及重大案件和诉讼的股票等），筛选得到本基金重点投资的股票池。通过每个上市公司的财务、投资吸引力等方面进行

分析，结合实地调研情况，构建投资股票投资组合。基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化，同时监控组合中证券的估值水平，在证券价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。

#### 4、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，本基金可以主动投资于权证，其投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金将利用权证达到控制下跌风险、增加收益的目的；同时，充分发掘权证与标的证券之间可能的套利机会，实现基金资产的增值。在权证投资中，本基金将对权证标的证券的基本面进行研究，综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素，对权证进行定价。

## 第9部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为人民币一年期银行定期存款基准利率税后收益率\*1.25

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。

## 第10部分 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。

## 第11部分 基金的投资组合报告

### 1、重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本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 2017 年 3 月 22 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 2016 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

## 2、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	73,043,558.88	15.44
	其中：股票	73,043,558.88	15.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	390,566,000.00	82.54
	其中：债券	390,566,000.00	82.54
	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	2,059,283.99	0.44
8	其他资产	7,497,670.68	1.58
9	合计	473,166,513.55	100.00

## 3、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	3,139,296.00	0.67
B	采矿业	878,572.00	0.19
C	制造业	43,302,813.88	9.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,984,166.00	0.63
E	建筑业	1,873,424.00	0.40
F	批发和零售业	2,900,030.00	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	569,426.00	0.12
H	住宿和餐饮业	596,646.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,331,410.00	0.49
J	金融业	5,536,492.00	1.17
K	房地产业	7,375,925.00	1.56
L	租赁和商务服务业	645,290.00	0.14

M	科学研究和技术服务业	546,336.00	0.12
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	363,732.00	0.08
	合计	73,043,558.88	15.49

#### 4、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

#### 5、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	600215	长春经开	65,800	811,972.00	0.17
2	000711	京蓝科技	20,700	673,578.00	0.14
3	600889	南京化纤	51,000	670,650.00	0.14
4	600853	龙建股份	95,700	663,201.00	0.14
5	600449	宁夏建材	53,400	649,878.00	0.14
6	600415	小商品城	74,600	645,290.00	0.14
7	600383	金地集团	49,300	638,928.00	0.14
8	600285	羚锐制药	49,944	637,285.44	0.14
9	002616	长青集团	31,900	636,086.00	0.13
10	000895	双汇发展	30,300	634,179.00	0.13

#### 6、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	30,054,000.00	6.37
	其中：政策性金融债	30,054,000.00	6.37
4	企业债券	91,278,000.00	19.35
5	企业短期融资券	149,974,000.00	31.80
6	中期票据	119,260,000.00	25.29
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	390,566,000.00	82.82

## 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	011699863	16 建发 SCP005	400,000	40,084,000.00	8.50
2	136344	16 广电 01	400,000	39,276,000.00	8.33
3	1382227	13 黄旅游 MTN1	300,000	30,687,000.00	6.51
4	122366	14 武钢债	300,000	30,300,000.00	6.42
5	011699974	16 鲁商 SCP005	300,000	30,057,000.00	6.37

## 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。

## 9、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。

## 10、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。

## 11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 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。

### 11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

## 12、投资组合报告附注

### 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，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 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。



### 13、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	100,499.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,395,379.88
5	应收申购款	1,791.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,497,670.68

### 14、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 15、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000711	京蓝科技	673,578.00	0.14	重大事项

### 16、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。

## 第12部分 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。

（一） 本基金合同生效日为 2015 年 9 月 9 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：历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

A 级

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	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

			③	④		
2015.09.09(基金合同生效日)~2015.12.31	2.55%	0.20%	0.62%	0.01%	1.93%	0.19%
2016.01.01~2016.12.31	-3.28%	0.25%	1.88%	0.01%	-5.16%	0.24%
2015.09.09(基金合同生效日)~2016.12.31	-0.81%	0.24%	2.51%	0.01%	-3.32%	0.23%

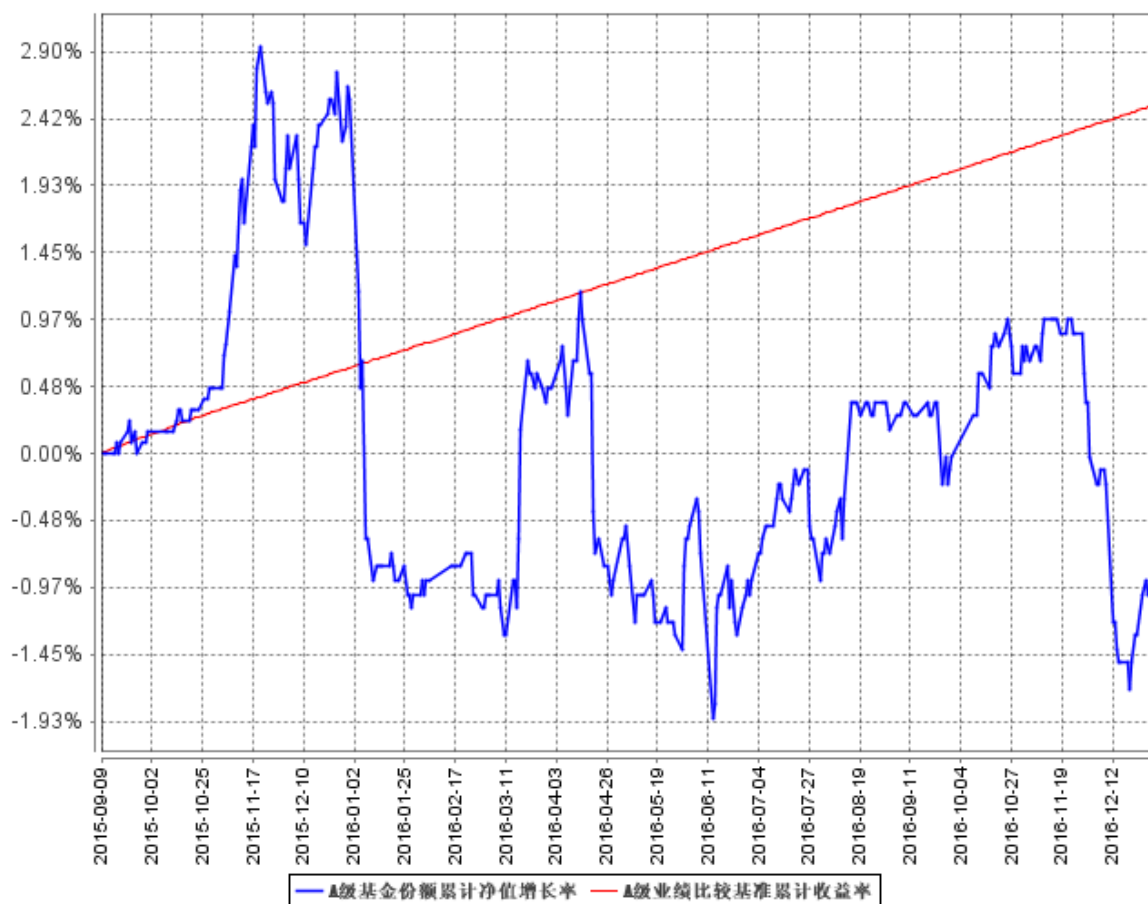
B 级

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
2015.09.09(基金合同生效日)~2015.12.31	2.49%	0.20%	0.62%	0.01%	1.87%	0.19%
2016.01.01~2016.12.31	-3.51%	0.25%	1.88%	0.01%	-5.39%	0.24%
2015.09.09(基金合同生效日)~2016.12.31	-1.11%	0.24%	2.51%	0.01%	-3.62%	0.23%

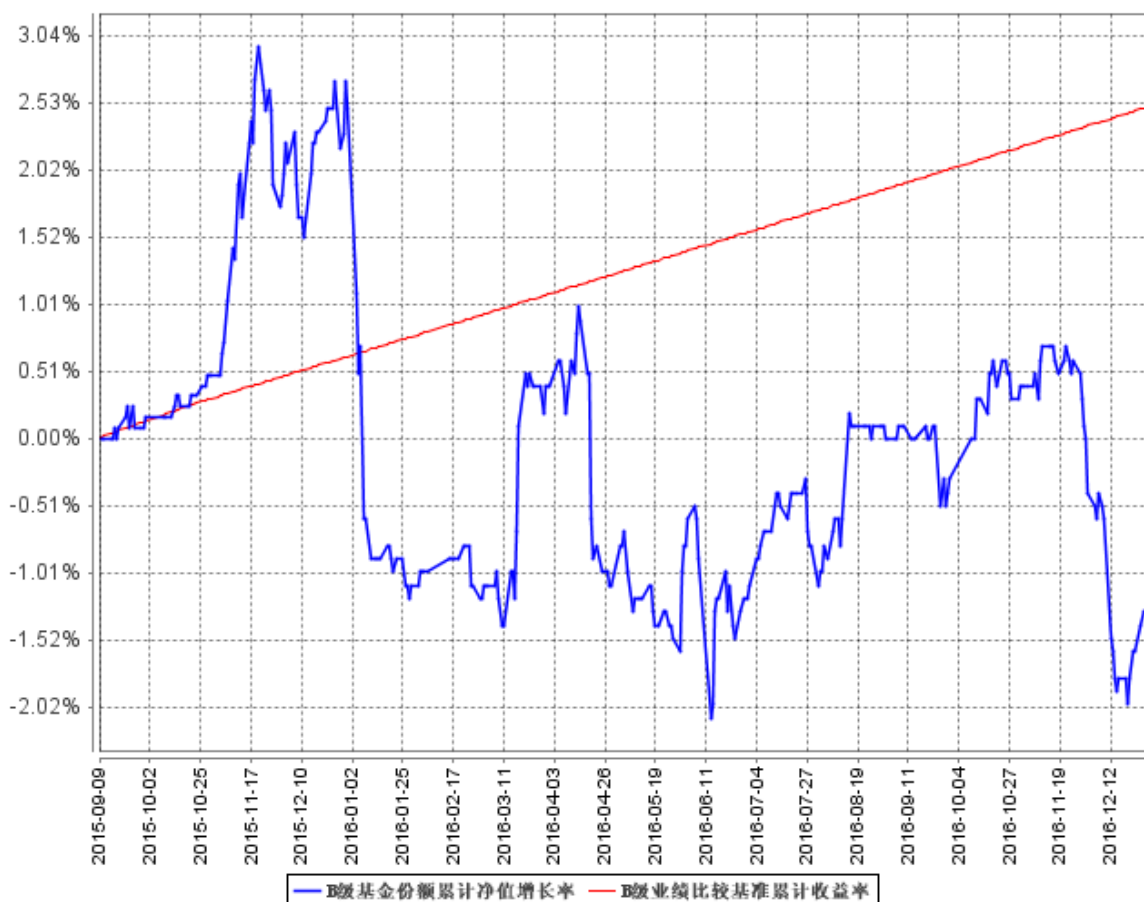
注：本基金业绩比较基准：人民银行一年期银行定期存款基准利率收益率(税后)\*1.25

(二) 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(2015年9月9日-2016年12月31日)

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



**B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：本基金成立于 2015 年 9 月 9 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。

## 第13部分 基金费用与税收

### 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 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

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 0.3%。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 0.3%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$

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（根据《泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金基金合同》的约定执行）；

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。

### 五、基金管理费、基金托管费、销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率、基金托管费率、销售服务费，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人须最迟于新费率实施日 2 日前在指定媒介刊登公告。

### 六、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

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》、《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”中对董事会成员、监事会成员、基金经理、投资决策委员会成员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”部分对代销机构信息进行了变更。

（五）“八、基金份额的申购与赎回”部分对申购费用与赎回费用进行了变更。

（六）“九、基金的投资”部分对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”中的内容。

泰达宏利基金管理有限公司

2017年4月22日