泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)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

泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金的募集申请已于2011年2月23日获中国证监会证监许可『2011』271号文核准,基金合同于2011年5月13日正式生效。根据基金合同的有关约定,泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金在基金合同生效满五年后封闭期届满,若满足基金合同约定的存续条件,无需召开基金份额持有人大会,自动转换成契约型上市开放式基金(LOF),基金名称变更为"泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)",聚利A、聚利B的基金份额转换为上市开放式基金(LOF)份额。

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。

本更新招募说明书摘要摘自更新招募说明书正文,投资者欲了解详细内容,应阅读更新招募说明书正文。

本更新招募说明书所载内容截止日为2017年5月13日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年3月31日。财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:泰达宏利基金管理有限公司

成立日期:2002年6月6日

注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人:弓劲梅

组织形式:有限责任公司

联系电话:010-66577808

信息披露联系人:陈沛

注册资本:一亿八千万元人民币

股权结构:北方国际信托股份有限公司:51%;宏利资产管理(香港)有限公司:49%。

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司,成立于2002年6月,是中国首批合资基金管理公司之一。截至目前,公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利收益增强债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利多元回报债券型证券投资基金、泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创益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、泰达宏利启惠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、泰达宏利启泽灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京天宝货币市场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等业务。同时何先生分别为宏利人寿保险(国际)有限公司及宏利资产管理(香港)有限公司之董事。现为澳大利亚精算学会及美国精算学会会员,在寿险及退休顾问工作方面拥有三十多年的丰富经验,其间担任多个领导层要职。

杜汉高先生,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,专门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,负责波士顿领导科学研发产品的开发工作。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职务,于业界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年任中银国际控股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,历任经济学系副主任、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。

横睿波先生,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。

葛文畅女士,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、总经理及其他高级管理人员

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、以及副总经理。2006年9月起任泰达宏利基金管理有限公司财务总监;2007年1月起任公司副总经理兼财务总监。

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

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

4、基金经理

丁宇佳女士,理学学士;2008年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任交易部交易员,负责债券交易工作;2013年9月起先后担任固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理;2015年3月26日至今担任泰达宏利货币市场基金基金经理; 2015年6月11日至今担任泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金经理; 2015年6月11日至今担任泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年6月16日至今担任泰达宏利养老收益混合型证券投资基金;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;2015年6月16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;2015年6月18日至今担任泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年11月4日至今担任泰达宏利活期友货币市场基金基金经理;2016年9月26日至今担任泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年9月26日至今担任泰达宏利风险预算混合型证券投资基金基金经理;2016年9月26日至今担任泰达宏利集利债券型证券投资基金基金经理;2016年9月29日至今担任泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年11月23日至今担任泰达宏利京元宝货币市场基金基金经理;2016年11月25日至今担任泰达宏利纯利债券型证券投资基金基金经理;2017年1月22日至今担任泰达宏利恒利债券型证券投资基金基金经理;2017年3月1日至今担任泰达宏利启泽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惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年3月10日至今担任泰达宏利京天宝货币市场基金基金经理;具备9年基金从业经验,9年证券投资管理经验,具有基金从业资格。

本基金历任基金经理:2011年5月至2012年9月,沈毅先生担任本基金基金经理。2011年5月至2015年6月,胡振仓先生担任本基金基金经理。2015年6月至2016年9月,卓若伟先生担任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员名单

投资决策委员会成员包括公司总经理刘建、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、金融工程部总监戴洁、研究部总监陈伯祯、资深基金经理兼首席策略分析师庄腾飞组成。督察长张萍列席会议。

投资决策委员会根据决策事项,可分类固定收益类事项、权益类事项、其它事项:

(1)固定收益类事项由刘建、王彦杰表决。

(2)权益类事项由刘建、王彦杰、邓艺颖、戴洁、陈伯祯、庄腾飞表决。

(3)其它事项由全体成员参与表决。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人:田国立

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人:王永民

传真:(010)66594942

中国银行客服电话:95566

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

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

(三)证券投资基金托管情况

截至2017年03月31日,中国银行已托管576只证券投资基金,其中境内基金541只,QDII基金35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。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)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

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:010-66577619、010-66577617

客服信箱:irm@mfcteda.com

客服电话:400-698-8888

传真:010-66577760/61

公司网站:http://www.mfcteda.com

2)泰达宏利基金网上直销系统

交易系统网址:http://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: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、浦发银行卡和汇付天下"天天盈"账户、快钱支付账户。

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、快钱支付账户。

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: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)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:王洪章

客服电话:95533

银行网站:www.ccb.com

(4)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

(5)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

(6)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

(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)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.nbcb.com.cn

(9)上海银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路168号

办公地址:上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人:金煜

开放式基金咨询电话:021-962888

开放式基金业务传真:021-68476111

网址:www.bankofshanghai.com

(10)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:吴建

客户服务电话:95577

网址:www.hxb.com.cn

(11)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:闫冰竹

客户服务电话:95526

公司网站:www.bankofbeijing.com.cn

(12)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8号富华大厦C座

办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人: 常振明

客服电话:95558

网址:http://bank.ecitic.com

(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

(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:天津市南开区宾水西道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@bhzq.com

客户服务电话: 400-651-5988

网址:www.bhzq.com

(15)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

(16)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

(17)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

公司网址: www.csc108.com

(18)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

(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

(20)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

(21)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

(22)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

(23)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: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

(24)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:95565,4008888111

公司网址:www.newone.com.cn

(25)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

(26)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:步国旬

联系人:王万君

联系电话:025-58519523

客户服务电话:95386

公司网址:www.njzq.com.cn

(27)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

(28)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

(29)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

(30)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

公司网址:www.hfzq.com.cn

(31)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

(32)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

(33)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

公司网址:www.tebon.com.cn

(34)安信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

法定代表人:王连志

客服电话:400-800-1001

联系人:陈剑虹

联系电话:0755-82825551

网址:www.essence.com.cn

(35)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

客服电话:95531,400-888-8588

(36)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

(37)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

(38)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

法定代表人:许建平

联系人:李巍

电话:010-88085858

客户服务电话:400-800-0562

网址:www.hysec.com

(39)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4008-888-999

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

(40)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.mszq.com

客服热线:400-619-8888

(41)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.gjzq.com.cn

联系人:刘婧漪、贾鹏

联系电话:028-86690057、028-86690058

传真号码:028-86690126

(42)中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人:王东明

公司网址:www.citics.com

客服热线:95548

(43)西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址:西藏自治区拉萨市北京中路101号

办公地址:上海市永和路118弄24号楼

法定代表人:陈宏

公司网址:www.xzsec.com

客服热线:400-911-2233

(44)西部证券股份有限公司

注册地址:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

办公地址:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人:刘建武

公司网址:www.westsecu.com

客服热线:95582

(45)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

客服热线:4001022011

(46)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

(47) 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

(48)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

(49)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址:上海市浦东新区银城中路68号8楼

法定代表人: 汪静波

公司网址:www.noah-fund.com

客服热线:400-821-5399

(50)深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址:深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼

法定代表人:薛峰

公司网址:www.zlfund.cn;www.jjmmw.com

客服热线:4006-788-887

(51)上海好买基金销售有限公司

注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人:杨文斌

公司网址:www.ehowbuy.com

客服热线:400-700-9665

(52)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:http://www.fund123.cn/

(53)上海天天基金销售有限公司

注册地址:浦东新区峨山路613号6幢551室

办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼

法定代表人:其实

客服电话:400-1818-188

公司网址:www.1234567.com.cn

(54)和讯信息科技有限公司

注册地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人:王莉

联系人:刘洋

联系电话:021-20835817

传真号码:021-20835885

全国统一客服热线:400-920-0022/ 021-20835588

公司网址:licaike.hexun.com

(55)北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦二层

法定代表人:闫振杰

全国统一客服热线:400-888-6661

公司网址:www.myfund.com

(56)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址:浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼4层

法定代表人:凌顺平

客户服务热线:4008-773-772

公司网址:www.5ifund.com

(57)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

(58)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璐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

(59)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: www.66zichan.com

(60)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

(61)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

(62)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

(63)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

(64)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

(65)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

(66)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

(67)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

(68)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

(69)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

(70)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中龙园3号

办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人:林卓

客服电话:400-6411-999

网址:www.taichengcaifu.com

(71)上海利得基金销售有限公司

公司地址:上海浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼

客服电话:400-921-7755

网址:www.leadfund.com.cn

本基金封闭期内基金份额只能通过场内交易机构在交易所市场上市交易, 不能通过直销机构和代销机构进行申购、赎回。

3、场内代销机构:本基金办理场内认购业务的发售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员(具体名单详见发售公告或相关业务公告)。尚未取得相应业务资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可在本基金上市后,代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

注册地址:北京西城区金融大街27号投资广场22、23层

办公地址:北京西城区金融大街27号投资广场22、23层

法人代表:金颖

联系人:朱立元

电话:010-58598839

传真:010-58598907

(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)

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼法定代表人:赵柏基

经办注册会计师:单峰、庞伊君

联系电话:021-23238888

传真:021-23238800

联系人:庞伊君

四、基金的名称

泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)

五、基金的类型

本基金类型:债券型

本基金运作方式:契约型

本基金存续期:不定期

本基金在基金合同生效后,在封闭期内不开放申购、赎回业务。

根据基金合同的有关约定,聚利A与聚利B已于2016年5月13日终止上市。聚利A和聚利B分别按照基金合同约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金(LOF)基金份额,转换后的基金份额于2016年5月25日在深圳证券交易所上市交易,详见基金管理人于2016年5月20日发布的《泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)上市交易公告书》。

六、基金的投资目标

本基金主要投资于固定收益证券,在合理控制信用风险的基础上,通过积极主动的管理,力求基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种。(但需符合中国证监会的相关规定)

本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可以参与A股股票(包含中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票)的新股申购或增发新股,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种。(但需符合中国证监会的相关规定)

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金在封闭期间,投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于80%,投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%。在开放期间,投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%;投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%,其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金所指信用债券是指企业债券、公司债券、短期融资券、商业银行金融债券、次级债、资产支持证券、可转换债券、可分离债券等非国家信用的固定收益类金融工具,以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金管理人自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合上述相关规定。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金以债券投资为主,最低投资比例为基金资产的80%,其中,投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于80%,股票等权益类资产投资比例最高为20%。本基金5年封闭期满转为上市开放式基金(LOF),将保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

(1)整体资产配置策略

对包括利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业率水平等在内的宏观经济指标进行分析,综合证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的情况分析,在整体资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

(2)类属资产配置策略

在整体资产配置策略的指导下,根据资产的收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类属资产收益差异、市场偏好、流动性等因素及法律法规的规定决定不同类属资产的目标配置比例,并定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。

(3)明细资产配置策略

首先根据明细资产的剩余期限、资产信用等级、流动性指标决定是否纳入组合;其次,根据个别债券的收益率与剩余期限的配比决定是否纳入组合;最后,根据个别债券的流动性指标决定投资总量。

2、债券投资策略

本基金债券投资将采取信用债券类金融工具类属配置策略、久期调整策略、收益率曲线策略、信用利差曲线配置策略、信用债券精选策略,在严格控制风险的前提下,实现风险和收益的最佳配比。

(1)信用债券类金融工具类属配置策略

类属配置是指对各市场及各种类的信用债券类金融工具之间的比例进行适时、动态的分配和调整,确定最能符合本基金风险收益特征的资产组合。具体包括市场配置和品种选择两个层面。

●信用等级配置:本基金将基于各品种信用债券类金融工具信用利差水平的变化特征、宏观经济预测分析以及税收因素的影响,综合考虑流动性、收益性等因素,采取定量分析和定性分析结合的方法,在各种信用债券类金融工具之间进行优化配置。

●市场配置:本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下,根据交易所市场和银行间市场等市场信用债券类金融工具到期收益率变化、流动性变化和市场规模等情况,相机调整不同市场中信用债券类金融工具所占投资比例。

(2)久期调整策略

本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断, 形成对未来市场利率变动方向的预期,进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值,达到增加收益或减少损失的目的。

●当预期市场总体利率水平降低时,本基金将延长所持有的债券组合的久期值,从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升收益;

●当预期市场总体利率水平上升时,则缩短组合久期,以规避债券价格下降的风险带来的资本损失,获得较高的再投资收益。

(3)收益率曲线配置策略

本基金将综合考察收益率曲线,通过预期收益率曲线形态变化趋势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,以便从收益率曲线的形变和不同期限信用债券的相对价格变化中获利。

●子弹策略:当预期收益率曲线变陡时,将采用子弹策略;

●哑铃策略:当预期收益率曲线变平时,将采用哑铃策略;

●梯形策略:在预期收益率曲线不变或平行移动时,则采用梯形策略。

(4)信用利差曲线配置策略

本基金将综合考察信用利差曲线,通过预期信用利差曲线走势来调整投资组合的头寸,即通过研究影响信用利差曲线的经济周期、市场供求关系和流动性变化等因素,确定信用债券的行业配置和各信用级别信用债券配置。

(5)信用债券精选策略

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并综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素,建立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,并通过这些模型进行估值,重点选择具备以下特征的信用债券:较高到期收益率、较高当期收入、价值被低估、预期信用质量将改善、属于创新品种而价值尚未被市场充分发现。

3、可转换公司债券投资策略

本基金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,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。

4、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,根据股票市场整体估值水平,发行定价水平及一级市场资金供求及资金成本关系,谨慎参与A股股票(包含中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票)的新股申购,获取股票一级市场与二级市场的差价收益。对于通过新股申购获得的股票,将在其可上市交易后30个交易日内全部卖出。

九、基金的业绩比较基准

中债企业债总全价指数收益率×90%+中债国债总全价指数收益率×10%

本基金集中投资于高收益信用债及国债, 因此选取了中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数作为基准。上述两个指数分别反映我国企业债市场和国债市场整体价格和投资回报情况,其样本与本基金的投资范围具有较高一致性,能够比较贴切的体现本基金的投资目标和风险收益特征。本基金根据在信用市场处于中性情况下的资产配置比例, 赋予复合基准中两个指数以90%和10%的权重,可以较为公允的衡量基金管理人的投资管理能力。

中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布。中央国债登记结算公司是财政部唯一授权主持建立、运营全国国债托管系统的机构,是中国人民银行指定的全国银行间债券市场债券登记、托管、结算机构和商业银行柜台记账式国债交易的一级托管人,作为指数发布主体具有绝对权威性。

中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数的构成品种完全覆盖了本基金的投资范围,反映债券全市场的整体价格和投资回报情况;同时,这两个指数在市场上具有较高的知名度,被广大投资者所认同,适合作为本基金的业绩比较基准。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准, 基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致, 并在更新的招募说明书中列示, 报中国证监会备案。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券市场中的较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)

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

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年5月31日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止2017年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,951,549.50	1.38
	其中:股票	7,951,549.50	1.38
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	554,229,899.00	96.31
	其中:债券	554,229,899.00	96.31
	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	2,389,652.75	0.42
8	其他资产	10,903,367.11	1.89
9	合计	575,474,468.36	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	4,373,460.00	0.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,578,089.50	0.80
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	7,951,549.50	1.78

3.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。

4.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	002521	齐峰新材	378,000	4,373,460.00	0.98
2	600023	浙能电力	627,735	3,578,089.50	0.80

注:以上为本基金本报告期末持有的全部股票投资。

5.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	70,467,000.00	15.79
	其中:政策性金融债	70,467,000.00	15.79
4	企业债券	73,505,971.40	16.47
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	407,229,000.00	91.26
7	可转债(可交换债)	3,027,927.60	0.68
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	554,229,899.00	124.21

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	170203	17国开03	500,000	49,855,000.00	11.17
2	101473006	14渝涪陵MTN001	400,000	42,228,000.00	9.46
3	1480038	14株洲国投债	300,000	32,697,000.00	7.33
4	101453009	14铁道MTN001	300,000	31,167,000.00	6.98
5	101461017	14神华MTN002	300,000	30,762,000.00	6.89

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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. 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。

9. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1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。

10.2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。

10.3本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

(1)基金投资前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(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。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	47,816.88
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	10,854,551.03
5	应收申购款	999.20
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	10,903,367.11

(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	113009	广汽转债	1,211,000.00	0.27

(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。

(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。

基金合同生效日为2011年5月13日,原泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金于2016年5月13日转型为泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)。

(一) 基金合同生效日至2016年5月13日的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

1、历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值增长率①	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
2011.5.13(基金合同生效日)~2011.12.31	2.10%	0.11%	-0.34%	0.12%	2.44%	-0.01%
2012.1.1~2012.12.31	12.34%	0.12%	2.53%	0.08%	9.81%	0.04%
2013.1.1~2013.12.31	0.09%	0.18%	-3.29%	0.09%	3.38%	0.09%
2014.1.1~2014.12.31	20.82%	0.27%	6.03%	0.12%	14.79%	0.15%
2015.1.1~2015.12.31	9.73%	0.25%	1.85%	0.08%	7.88%	0.17%
2016.1.1~2016.5.13	-0.04%	0.09%	-2.85%	0.11%	2.81%	-0.02%
基金合同生效至2016.5.13	52.13%	0.20%	3.67%	0.10%	48.46%	0.10%

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

2、自基金合同生效日至2016年5月13日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(2011年5月13日-2016年5月13日)

本基金在建仓期结束时及报告期末,各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

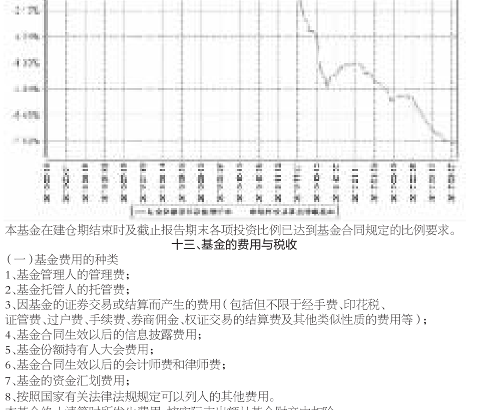
(二)2016年5月14日以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

1、历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016.5.14~2016.12.31	0.80%	0.10%	-4.51%	0.11%	5.31%	-0.01%
2017.1.1~2017.3.31	0.30%	0.07%	-3.30%	0.10%	3.60%	-0.03%
2016.5.14~2017.3.31	1.10%	0.09%	-7.66%	0.11%	8.76%	-0.02%

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

2、2016年5月14日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(2016年5月14日-2017年3月31日)



本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、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);

4、基金合同生效以后的信息披露费用;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金合同生效以后的会计师费和律师费;

7、基金的资金汇划费用;

8、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)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)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

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×年管理费率÷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×年托管费率÷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。

(四)与基金销售有关的费用

1、基金的申购费用

本基金的申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见"十、基金份额的申购与赎回"一章。

2、基金的赎回费用

本基金的赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见"十、基金份额的申购与赎回"一章。

(五)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。

(六)基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(七)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》、《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)在"三、基金管理人"中的基金管理人概况、监事会成员、基金经理等部分内容进行了变更。

(三)在"四、基金托管人"中的基金托管人部分信息进行了更新。

(四) "五、相关服务机构" 部分对代销机构信息部分内容进行了更新。

(五) "十一、基金的投资" 部分对投资组合报告内容更新至2017年3月31日。

(六)"十二、基金的业绩" 部分对基金业绩更新至2017年3月31日,并更新了历史走势对比图。

(七)更新了"二十五、其他应披露事项" 的内容。

泰达宏利基金管理有限公司

2017年6月26日