

## 泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金

## 2016年度报告摘要

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  
送出日期:2017年3月30日

## § 1 重要提示

1.1 重要提示  
本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

1.2 重要提示  
基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月28日核对了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

基金简称	泰达宏利瑞利债券
基金代码	000087
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
基金合同生效日	2015年11月14日
基金类型	债券型
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
基金合同生效后的基金总份额	249,971,144.70份
基金合同生效后的基金份额净值	1.00元
下属分级基金的基金简称	泰达宏利瑞利债券A
下属分级基金的交易代码	000087
报告期末下属分级基金的份额	30,140,265.79份
报告期末下属分级基金的净值	209,830,882.92份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过严格的风险控制,在合理控制风险的基础上,在保持资产流动性的同时,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在综合分析宏观经济、利率、信用、税赋、流动性、通货膨胀、汇率、政策、市场等多方面因素的基础上,在严格控制风险的前提下,通过资产配置,在不同资产类别之间进行动态调整,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩基准	中证综合债券指数(全价)
风险收益特征	本基金为债券型基金,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。
风险等级	中低风险
下属分级基金的名称	泰达宏利瑞利债券A
下属分级基金的交易代码	000087
报告期末下属分级基金的份额	30,140,265.79份
报告期末下属分级基金的净值	209,830,882.92份

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
住所	渤海国际金融中心	北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人	孙晓明	王永军
信息披露负责人	孙晓明 010-66277200	010-66204906
客户服务电话	400-0-888888	95566
传真	010-66277006	010-66204942

## 2.4 信息披露方式

基金的披露方式	披露方式	披露时间
基金定期报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	每季度结束之日起15个工作日内

基金年度报告	披露方式	披露时间
基金年度报告	基金管理人网站	每年结束之日起45个工作日内

## 3. 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

项目	2016年末	2016年初	2014年末
本期末的净资产	31,340,420.00	81,099,388.74	120,611,084.92
本期初的净资产	11,011,090.04	79,121,730.07	160,906,842.23
平均每日基金份额本期利润	0.0240	0.0702	0.0770
本期基金份额净利得率	1.47%	12.19%	7.95%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

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

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

3.2.4 基金净值表现

3.2.5 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.6 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.7 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.8 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.9 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.10 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.11 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.12 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.13 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.14 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.15 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.16 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.17 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.18 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.19 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.20 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.21 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.22 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.23 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.24 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.25 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.26 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.27 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.28 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.29 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.30 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.31 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.32 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.33 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.34 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.35 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.36 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.37 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.38 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.39 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.40 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.41 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.42 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.43 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.44 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.45 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.46 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.47 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.48 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.49 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.50 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.51 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.52 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.53 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.54 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.55 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.56 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.57 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.58 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.59 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.60 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.61 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.62 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.63 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.64 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.65 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.66 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.67 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.68 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.69 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.70 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.71 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.72 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.73 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较