(上接B009版)

T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

5、丰利A和丰利B的基金份额净值计算

本基金《基金合同》生效后,在丰利A的开放日计算丰利A的基金份额净值;在基金转换时的份额转换基准日分别计算丰利A和丰利B的基金份额净值。

(1)丰利A的基金份额净值计算

[illegible]

6、丰利A和丰利B的基金份额参考净值计算

本基金在分级基金运作期内,基金管理人在计算基金资产净值的基础上,采用"虚拟清算"原则分别计算并公告丰利A和丰利B的基金份额参考净值,其中,丰利A的基金份额参考净值计算日不包括丰利A的开放日。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算,并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

(1)丰利A的基金份额参考净值计算

[illegible]

上式中,在丰利A的非开放日,$NAV_{参}$为丰利A的基金份额参考净值;在丰利A的开放日,$NAV_{参}$为丰利A的基金份额净值。

丰利A、丰利B的基金份额参考净值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

T日的丰利A和丰利B的基金份额参考净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

例3:本基金在分级基金运作期内,设自丰利A上一次开放日起的运作天数为50天,基金运作当年的实际天数为365天,基金资产净值为41亿元,丰利A、丰利B的份额余额分别为30亿份和10亿份,丰利A上一次开放日设定的丰利A年收益率为4.73%。则丰利A、丰利B的基金份额参考净值计算如下:

[illegible]

(二)《基金合同》生效后3年期届满时的基金份额转换

本基金《基金合同》生效后3年期届满,本基金将根据《基金合同》的约定转换为上市开放式基金(LOF),本基金不再进行基金份额分级,丰利A、丰利B的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金(LOF)份额,并办理基金的申购与赎回业务。

本基金管理人已于2014年10月13日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人官方网站(www.thfund.com.cn)披露了《天弘丰利分级债券型证券投资基金三年期届满与基金份额转换的公告》。投资者可通过上述渠道查询本基金转型的相关事宜。。

五、基金的名称

本基金名称:天弘丰利分级债券型证券投资基金。

六、基金的类型

本基金类型:债券型。

七、丰利A的基金份额折算

本基金在分级基金运作期内,丰利A将按以下规则进行基金份额折算。

(一)折算基准日

本基金在分级基金运作期内,丰利A的基金份额折算基准日为自《基金合同》生效之日起每满6个月的最后一个工作日。

丰利A的基金份额折算基准日与其开放日为同一个工作日。本招募说明书更新期间,丰利A于折算基准日2014年5月22日进行了折算。

(二)折算对象

基金份额折算基准日登记在册的丰利A所有份额。

(三)折算频率

自《基金合同》生效之日起每满6个月折算一次。

(四)折算方式

折算日日终,丰利A的基金份额净值调整为1.0000元,折算后,基金份额持有人持有的丰利A的份额数按照折算比例相应增减。

丰利A的基金份额折算公式如下:

丰利A的折算比例=折算日折算前丰利A的基金份额净值/1.0000

丰利A经折算后的份额数=折算前丰利A的份额数×丰利A的折算比例

丰利A经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位,由此产生的误差计入基金财产。

在实施基金份额折算时,折算日折算前丰利A的基金份额净值、丰利A的折算比例的具体计算见基金管理人在指定媒体及公司网站发布的折算结果公告。

(五)基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作,基金管理人根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,于丰利A打开赎回业务的公告披露当日向深圳证券交易所申请了丰利B暂停交易一小时。由于本次丰利A的开放日的次一个工作日为本基金的份额转换基准日,丰利B将于该日终止上市,终止上市的相关信息详见基金管理人2014年11月19日披露的《天弘丰利分级债券型证券投资基金之丰利B终止上市的公告》。

八、基金份额的上市交易

(一)上市交易的基金份额

本基金在分级基金运作期内,在丰利B符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下,丰利B的基金份额将申请在深圳证券交易所上市交易。丰利B上市后,登记在证券登记结算系统中的丰利B份额可直接在深圳证券交易所上市交易;登记在注册登记系统中的丰利B份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中,再上市交易。

本基金根据《基金合同》的约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金(LOF)份额,转换后的基金份额将继续在深圳证券交易所上市交易。基金上市后,登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易;登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中,再上市交易。

(二)上市交易的地点

深圳证券交易所。

(三)上市交易的时间

丰利B基金份额已于2012年2月20日在深圳证券交易所上市交易。

本基金根据《基金合同》的约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金(LOF)份额后,本基金将自转换为上市开放式基金(LOF)之日起30日内继续在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易时间后,基金管理人最迟在上市前3个工作日在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告。

(四)上市交易的规则

1、丰利B上市首日的开盘参考价为其前一工作日的基金份额参考净值;

2、本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金上市首日的开盘参考价为前一个工作日的基金份额净值;

3、本基金实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为10%,自上市首日起实行;

4、本基金买入申报数量为100份或其整数倍;

5、本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币;

6、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

(五)上市交易的费用

本基金(本基金在分级基金运作期内,指丰利B)上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

(六)上市交易的行情揭示

本基金(本基金在分级基金运作期内,指丰利B)在深圳交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日的基金份额净值(本基金在分级基金运作期内,为丰利B的基金份额参考净值)。

(七)上市交易的停复牌与暂停、终止上市

本基金(本基金在分级基金运作期内,指丰利B)的停复牌与暂停、终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

(八)相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,本基金《基金合同》相应予以修改,且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

九、基金转型与基金份额转换

(一)基金转型

本基金《基金合同》生效后3年期届满,本基金无需召开基金份额持有人大会,自动转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为"天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)"。

本基金转换为上市开放式基金(LOF)时,丰利A、丰利B的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金(LOF)份额,并办理基金的申购与赎回业务。本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。

(二)基金转型时丰利A的处理方式

本基金《基金合同》生效后3年期届满日为自《基金合同》生效之日后3年的对应日。如该对应日为非工作日,则顺延至下一个工作日。《基金合同》生效后3年期届满日与丰利B的封闭期届满日为同一日。

本基金《基金合同》生效后3年期届满日前,基金管理人将提前公告并提示丰利A的基金份额持有人可选择在3年内最后一个开放日赎回丰利A份额或默认届满日自动转换为上市开放式基金(LOF)份额。

(三)基金转型时的份额转换规则

1、份额转换基准日

本基金《基金合同》生效后3年期届满日,即本基金基金合同生效之日起3年后的对应日,如该日为非工作日,则顺延至下一个工作日。

2、份额转换方式

在份额转换基准日,本基金转换成上市开放式基金(LOF)后的基金份额净值调整为1.0000元。

在份额转换基准日日终,以份额转换后1.0000元的基金份额净值为基准,丰利A、丰利B按照各自的基金份额净值转换成上市开放式基金(LOF)份额。

份额转换计算公式:

丰利A份额(或丰利B份额)的转换比率=份额转换基准日丰利A(或丰利B)的基金份额净值/1.0000

丰利A(或丰利B)基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金(LOF)份额=基金份额持有人持有的转换前丰利A(或丰利B)的份额数×丰利A份额(或丰利B份额)的转换比率

在进行份额转换时,丰利A、丰利B的场外份额将转换成上市开放式基金(LOF)场外份额,且均登记在注册登记系统下;丰利B的场内份额将转换成上市开放式基金(LOF)场内份额,仍登记在证券登记结算系统下。

在实施基金份额转换时,丰利A份额(或丰利B份额)的转换比率、丰利A(或丰利B)基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金(LOF)份额的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

3、份额转换后的基金运作

丰利A、丰利B的份额全部转换为上市开放式基金(LOF)份额之日起30日内,本基金将上市交易,并接受场外与场内申购和赎回。份额转换后本基金上市交易、开始办理申购与赎回的具体日期见基金管理人届时发布的相关公告。

4、份额转换的公告

(1)本基金将转换为上市开放式基金(LOF)时,基金管理人将依照相关法律法规的规定就本基金进行基金转换的相关事宜进行公告,并报中国证监会备案;

(2)在本基金《基金合同》生效后3年期届满日前30个工作日,基金管理人将就本基金进行基金转换的相关事宜进行提示性公告;

(3)丰利A、丰利B进行份额转换结束后,基金管理人应在2日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告,并报中国证监会备案。

(四)基金转型后基金的投资管理

本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变。

十、基金的投资目标

本基金在追求基金资产稳定增值的基础上,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

十一、基金的投资方向

本基金的投资对象是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债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款以及法律、法规或监管机构允许基金投资的其它固定收益类金融工具及其衍生工具(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、增发、可转债转股、所持股票配售及派发、权证行权所形成的股票,以及所持股票派发和可分离债券分离所形成的权证等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他权益类金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起90个交易日内卖出。

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。

本基金对债券等固定收益类证券的投资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不低于40%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金对股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%。

本基金所指信用债券是指企业债、公司债、短期融资券、地方政府债券、商业银行金融债、商业银行次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券等除国债、政策性金融债和央行票据之外的、非国家信用的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。

十二、基金的投资策略

本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测,采取自上而下和自下而上相结合的投资策略,构建和调整固定收益证券投资组合并适度参与新股投资,力求实现风险与收益的优化平衡。

1、资产配置策略

本基金采取积极的主动投资管理策略,自上而下确定大类资产配置和信用债券类金融工具的类属配置比例,动态调整固定收益类证券组合久期和信用债券的结构,并根据股票市场的趋势研判及新股申购收益率预测,适度参与一级市场新股与增发新股的申购,力求提高基金收益率。

2、信用债券投资策略

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不同市场上信用债券类金融工具的到期收益率、流动性和市场规模等情况,并结合各信用债券品种之间的信用利差水平变化特征、宏观经济变化以及税收因素等的预测分析,采取定量分析和定性分析结合的方法,对各类信用债券金融工具进行优化配置。

(1)久期选择

本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势,判断债券市场的未来走势,并形成对未来市场利率变动方向的预期,动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时,适当提高组合久期,以分享债券市场上涨的收益;当预期收益率曲线上移时,适当降低组合久期,以规避债券市场下跌的风险。

(2)收益率曲线分析

本基金除考虑系统性的利率风险对收益率曲线形状的影响之外,还将考虑债券市场微观因素对收益率曲线的影响,如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等,形成一定阶段内的收益率曲线变动趋势的预期,并适时调整基金的债券投资组合。

本基金还将通过对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的研判,确定信用债券的行业配置和各信用级别信用债券所占的投资比例。

(3)信用风险分析

本基金通过对信用债券发行人基本面的深入调研分析,结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果,选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

(4)信用债券品种选择

本基金根据信用债券市场收益率数据,运用利率模型对单个债券进行估值分析,并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋等因素,选择具有良好投资价值的信用债券品种进行投资。

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,进而构建本基金可转换公司债券的投资组合。

本基金在全面分析可转换公司债券基本面的基础上,综合运用衍生工具定价模型,通过对不同市场环境下可转换公司债券的股性与债性的合理定价,选择基础股票基本面优良,具有较强赢利能力和成长前景的优质可转换债券构建组合,获取稳健的投资回报。

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,综合运用衍生工具定价模型分析评估其内在价值。

3、国债及央行票据投资策略

国债及央行票据受货币政策、利率周期、通货膨胀等宏观因素影响较大,在综合分析以上因素的基础上,本基金主要采用久期管理、跨市场套利、回购套利、收益率曲线策略等构建投资组合,力求在控制利率风险的基础上,获得较好的投资收益。

4、新股申购策略

本基金将在审慎原则下参与一级市场新股与增发新股的申购。通过研究首次发行股票及增发新股的上市公司基本面因素,分析新股内在价值、市场溢价率、中签率和申购机会成本等综合评估申购收益率,从而制定相应的申购策略以及择时卖出策略。

十三、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中债综合指数。

中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布,该指数样本具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),是中国目前最权威、应用也最广的指数。中债综合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,适合作为本基金的业绩比较基准。

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债券指数时,基金管理人和基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,可以变更本基金业绩比较基准并及时公告。

十四、风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

本基金在分级基金运作期内,本基金经过基金份额分级后,丰利A为低风险、收益相对稳定的基金份额;丰利B为较高风险、较高收益的基金份额。

十五、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年12月9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至2014年9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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,415,576,802.03	94.12
	其中:债券	1,415,576,802.03	94.12
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
	其中:权证	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	43,236,075.91	2.87
6	其他各项资产	45,158,127.06	3.00
7	合计	1,503,971,005.00	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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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	9,994,000.00	1.16
	其中:政策性金融债	9,994,000.00	1.16
4	企业债券	1,336,123,624.83	154.43
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	49,819,000.00	5.76
7	可转债	19,640,177.20	2.27
8	其他	-	-
9	合计	1,415,576,802.03	163.61

5、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	112048	11凯迪债	827,500	85,700,037.50	9.91
2	122126	11庞大02	800,000	82,064,000.00	9.48
3	122776	11新光债	800,000	80,984,000.00	9.36
4	122110	11众和债	802,160	79,325,602.40	9.17
5	1480465	14北辰科技债	700,000	70,805,000.00	8.18

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名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

本基金本报告期末未持有国债期货。

10、投资组合报告附注

(1)本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2)本基金本报告期末未持有股票,故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,950.40
2	应收证券清算款	1,022,607.99
3	应收股利	-
4	应收利息	44,100,445.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,123.21
8	其他	-
9	合计	45,158,127.06

(4)本基金本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	110020	南山转债	18,226,620.00	2.11
2	113003	重工转债	1,413,557.20	0.16

(5)本基金本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

(6)投资组合报告附注的其他文字表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。

十六、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2011年11月23日,基金业绩数据截至2014年9月30日。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2011/11/23-2011/12/31	0.97%	0.11%	0.87%	0.11%	0.10%	0.00%
2012/01/01-2012/12/31	16.70%	0.35%	0.37%	0.06%	16.33%	0.29%
2013/01/01-2013/12/31	7.30%	0.61%	-3.75%	0.08%	11.05%	0.53%
2014/01/01-2014/09/30	13.85%	0.43%	4.80%	0.08%	9.05%	0.35%
自基金合同生效日(2011/11/23)-2014/09/30	43.95%	0.47%	2.12%	0.08%	41.83%	0.39%

十七、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、基金销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

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。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(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0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.70%÷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

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核无误后于次月首日起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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.20%÷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

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核无误后于次月首日起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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

3、销售服务费

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。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.35%年费率计提。基金销售服务费费的计算方法如下:

H=E×0.35%÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

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,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划出,由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

上述"一、基金费用的种类"中第4-9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

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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体上公告。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十八、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金管理人于2014年7月4日公告的《天弘丰利分级债券型证券投资基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在"三、基金管理人"部分,根据公司管理基金规模及的变化和业务部门调整情况,对本管理人管理基金的情况、业务部门结构进行了更新;

2、在"四、基金托管人"部分,根据基金托管人提供的内容做了相应的更新;

3、在"五、相关服务机构"部分,更新了场外非直销机构的信息;

4、在"六、基金份额的分级"部分,更新了基金转型的相关信息

5、在"九、丰利A的基金份额折算"部分,更新了相关信息;

6、在"十、基金份额的申购与赎回"部分,更新了本基金本招募说明书更新期间开放赎回业务的办理时间及本基金转型后的赎回费率的相关信息;

7、在"十五、基金投资组合报告"部分,按有关规定补充了本基金近一期投资组合报告的内容;

8、在"十六、基金的业绩"部分,更新了基金业绩数据,并经基金托管人复核;

9、在"二十八、其他应披露的事项"部分,对本次更新内容期间的历次公告进行了更新。

天弘基金管理有限公司
二〇一五年一月六日

证券代码:002374 证券简称:丽鹏股份 公告编号:2015-01

关于召开山东丽鹏股份有限公司2015年第一次临时股东大会的提示性公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,公告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

根据《公司法》和《公司章程》的有关规定,经山东丽鹏股份有限公司(以下简称"公司")第三届董事会第八次会议审议通过,公司决定于2015年1月8日召开2015年第一次临时股东大会(以下简称"股东大会"),本次股东大会将通过深圳证券交易所系统向社会公众股东提供网络投票平台,根据中国证监会《关于加强社会公众股股东权益保护的若干规定》的要求,现就本次股东大会发布提示性公告:

公司第三届董事会第八次会议决议,于2015年1月8日召开公司2015年第一次临时股东大会,现将本次会议的有关事项通知如下:

一、召开会议的基本情况:

1、会议召集人:公司董事会

2、会议召开方式:现场召开、网络投票

3、(1)现场会议召开时间:2015年1月8日(星期四)下午14时,会期半天;为保证会议按时召开,现场登记时间截至13时30分;

(2)网络投票时间:2015年1月7日—1月8日,其中,通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的时间为2015年1月8日上午9:30-11:30,下午13:00-15:00;通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的具体时间为2015年1月7日15:00至2015年1月8日15:00的任意时间。

4、股权登记日:2015年1月5日

5、现场会议召开地点:烟台市牟平区姜格庄街道办事处丽鹏路1号山东丽鹏股份有限公司会议室;

6、表决方式:现场投票和网络投票相结合的方式。公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统(http://wltp.cninfo.com.cn)向公司股东提供网络投票平台,公司股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权,投票代码:362374,投票简称:丽鹏投票。

7、投票规则:

本次股东大会提供现场投票和网络投票两种投票表决方式,同一股份只能选择现场投票或网络投票中的一种表决方式,不能重复投票。股东可以在网络投票时间内通过深圳证券交易所的交易系统和互联网投票系统(http://wltp.cninfo.com.cn)行使表决权。同一股份通过现场方式和网络方式重复进行投票的,以第一次投票结果为准。

二、会议议题

1、审议《关于变更部分董事及独立董事的议案》,本次提名非独立董事、独立董事将分别采用累积投票制。

1.1提名汤于先生为公司第三届董事会非独立董事;

1.2提名秦华先生为公司第三届董事会独立董事;

1.3提名秦书尧先生为公司第三届董事会独立董事;

2、审议《关于修改<山东丽鹏股份有限公司股东大会议事规则>的议案》;

3、审议《关于为全资子公司银行授信提供担保的议案》

4、审议《关于修改<公司章程>的议案》;

三、出席会议对象:

1、截至2015年1月5日下午交易结束后,在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的公司股东或股东代理人,该股东代理人不必是公司的股东

2、公司董事、监事和高级管理人员

3、公司聘请的律师或其它董事会邀请的嘉宾

四、参加现场会议登记办法:

1、登记时间:2015年1月6日,上午8:30-11:30,下午14:00-17:00

2、登记地点:烟台市牟平区姜格庄街道办事处丽鹏路1号山东丽鹏股份有限公司证券部

3、登记办法:

(1)自然人股东持本人身份证、股东账户卡等办理登记手续;委托代理人持本人身份证、股东账户卡、股东授权委托书等办理登记手续;

(2)法人股东由其法定代表人出席会议的,应持本人身份证、营业执照复印件(加盖公章)办理登记手续;由其法定代表人委托的代理人出席会议的,应持本人身份证、营业执照复印件(加盖公章)和法定代表人依法出具的书面委托书办理登记手续;

(3)异地股东可以凭以上有关证件采取信函或传真方式登记(须在2015年1月6日下午5点前送达或传真至公司证券部),不接受电话登记。

五、参与网络投票的股东的身份认证与投票程序

(一)采用交易系统投票的投票程序

1、本次股东大会通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的时间为2015年1月8日上午9:30—11:30,下午13:00-15:00,投票程序比照深圳证券交易所新股申购业务操作。

2、投票代码:362374;投票简称:"丽鹏投票"。

3、股东投票的具体程序为:

(1)买卖方向为买入投票。

(2)在"委托价格"项下填报本次股东大会的申报价格:100.00元代表总议案,每一议案应以相应的价格分别申报,具体如下表:

议案	对应申报价格(元)
总议案	100.00
1、《关于变更部分董事及独立董事的议案》	
1.1选举汤于先生为公司第三届董事会非独立董事	1.01
1.2选举秦华先生为公司第三届董事会独立董事	2.01
1.3选举秦书尧先生为公司第三届董事会独立董事	2.02
2、《关于修改<山东丽鹏股份有限公司股东大会议事规则>的议案》	3.00
3、《关于为全资子公司银行授信提供担保的议案》	4.00
4、《关于修改<公司章程>的议案》	5.00

(3)在"委托股数"项下填报表决意见,1股代表同意,2股代表反对,3股代表弃权;表决意见种类对应的申报股数:

表决意见种类	对应申报股数
同意	1股
反对	2股
弃权	3股

在"委托数量"项下填报投给某候选人的选举票数。股东拥有的表决票总数具体如下:

议案1.1选举非独立董事1名,股东拥有的表决票总数=持有股份数×1;

议案1.2选举独立董事1名,股东拥有的表决票总数=持有股份数×1;

议案1.3选举独立董事1名,股东拥有的表决票总数=持有股份数×1;

(4)对同一表决事项的投票只能申报一次,不能撤单,多次申报的,以第一次申报为准。

(5)不符合上述规定的申报无效,深圳证券交易所交易系统作自动撤单处理。

(6)如需查询投票结果,请于投票当日下午18:00以后登录深圳证券交易所互联网投票系统(http://wltp.cninfo.com.cn),点击"投票查询"功能,可以查看个人网络投票结果,或通过投票委托的证券公司营业部查询。

4、投票举例

(1)股权登记日持有"丽鹏股份"A股的投资者,对公司全部议案投同意票,其申报如下:

投票代码	买卖方向	申报价格	申报股数
362374	买入	100.00元	1股

(2)如某股东对议案二投赞成票,对议案三投弃权票,申报顺序如下:

投票代码	买卖方向	申报价格	申报股数
362374	买入	3.00元	1股
362374	买入	4.00元	3股

(二)采用互联网投票的操作流程:

1、股东获取身份认证的具体流程按照《深圳证券交易所投资者网络服务身份认证业务实施细则》的规定,股东可以采用服务密码或数字证书的方式进行身份认证。

(1)申请服务密码的流程

登陆网址http://wltp.cninfo.com.cn的密码服务专区注册;填写"姓名"、"证券账户号"等相关信息并设置服务密码,如申请成功,系统会返回一个4位数字的激活校验码。

(2)激活服务密码

股东通过深交所交易系统比照买入股票的方式,凭借"激活校验码"激活服务密码。该服务密码通过交易系统激活成功后5分钟即可使用。服务密码激活后长期有效,在参加其他网络投票时不必重新激活。密码激活后如遗失可通过交易系统挂失,挂失后可重新申请,挂失方法与激活方法类似。申请数字证书的,可向深圳证券信息公司或其委托的代理发证机构申请。

2、股东根据获取的服务密码或数字证书登录网址http://wltp.cninfo.com.cn的互联网投票系统进行投票。

(1)登录http://wltp.cninfo.com.cn,在"上市公司股东大会列表"选择"山东丽鹏股份有限公司2015年第一次临时股东大会投票"。

(2)进入后点击"投票登录",选择"用户名密码登陆",输入您的"证券账户号"和"服务密码";已申领数字证书的投资者可选择CA证书登录。

(3)进入后点击"投票表决",根据网页提示进行相应操作。

(4)确认并发送投票结果。

3、股东进行投票的时间

通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的具体时间为:2015年1月7日15:00至2015年1月8日15:00的任意时间。

六、其他事项:

1