（下转B045版）

54）广发证券股份有限公司
住所：广州市天河区天河北路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
电话：020-87555888
传真：020-87555305
联系人：黄岚
客户服务热线：95575
网址：www.gf.com.cn
55）浙商证券有限责任公司
住所：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7楼
办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7楼
法定代表人：吴承根
电话：0571-87901912
传真：0571-87902092
联系人：毛亚莉
客户服务热线：0571-967777
网址：www.stocke.com.cn
56）国海证券股份有限公司
住所：广西桂林市辅星路13号
办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
法定代表人：张雅锋
电话：0755-83709350
传真：0755-83700205
联系人：牛梦雨
客户服务热线：95563
网址：www.ghzq.com.cn
57）湘财证券有限责任公司
住所：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楼
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楼
法定代表人：林俊波
电话：021-68634518
传真：021-68865680
联系人：李欣
客户服务热线：400-888-1551
网址：www.xcsc.com
58）联讯证券有限责任公司
住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人：徐刚
电话：0752-2119397
传真：0752-2119396
联系人：郭晴
客户服务热线：400-8888-929
网址：www.lxzq.com.cn
59）东北证券股份有限公司
住所：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
电话：0431-85096517
传真：0431-85096795
联系人：安岩岩
客户服务热线：400-600-0686
网址：www.nesc.cn
60）兴业证券股份有限公司
住所：福州市湖东路268号
办公地址：福州市湖东路268号证券大厦16F
法定代表人：兰荣
电话：0591-38162212
传真：0591-38507538
联系人：夏中苏
客户服务热线：95562
网址：www.xyzq.com.cn
61）中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
电话：010-65183880
传真：010-65182261
联系人：张颤
客户服务热线：400-8888-108
网址：www.csc108.com
62）大同证券经纪有限责任公司
住所：山西省太原市长治路111 号山西世贸中心A 座12层
办公地址：山西省太原市长治路111 号山西世贸中心A 座12层
法定代表人：董祥
电话：0351-7219303
联系人：张冠
客户服务热线：4007121212
网址：www.dtsbc.com.cn
63）中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人：丁学东
电话：010-65051166
联系人：杨涵宇
客户服务热线：400-910-1166
网址：www.rtfund.com
64）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：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
法定代表人：姚文平
联系人：朱磊
客户服务热线：95353
网址：http://www.tebon.com.cn/
65）东吴证券股份有限公司
注册地址：苏州工业园区星阳街5号
办公地址：苏州工业园区星阳街5号
法定代表人：范力
电话：0512-62938521
联系人：陆晓
客户服务热线：400-860-1555
网址：http://www.dwjq.com.cn/
66）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号中信证券大厦14层
法定代表人：张皓
电话：0755 -23953913
联系人：洪诚
客户服务热线：400-9908-826
网址：www.citicsf.com
67）北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
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：北京朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦16号
法定代表人：张冠宇
联系电话：010-53570573
传真：010-59200800
联系人：刘美薇
客服电话：400-819-9868
网址：http://www.tdyhfund.com/
68）北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
办公地址：北京市朝阳区西大望路1号特莱中心16层1603室
法定代表人：董浩
联系人：张婷婷
69）北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层 1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号丹棱soho1008-1012
法定代表人：赵荣春
联系人：车倩倩
电话：010-56183769
传真：010-57569671
客服电话：400-893-6885
网址：www.dyxtw.com
70）浙江同花顺基金销售有限公司
办公地址：浙江省杭州市文二西路1号903
法定代表人：凌顺平
联系人：林海明
电话：0571-88911818-8580
客服电话：4008-773-772
网址：www.5ifund.com?
71）珠海盈米财富管理有限公司
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
联系人：钟琛
电话：15622308091
客服电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn
72）北京恒天明泽基金销售有限公司
办公地址：北京市朝阳区东三环北路20号乐成中心A座23层
法定代表人：黄永伟
联系人：王海烨
电话：010-58845311
客服电话：4008-980-618
网址：www.chtfund.com
73）上海长量基金销售投资顾问有限公司
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：唐诗洋
电话：021-20691926
客服电话：400-820-2899
网址：http://www.erichfund.com/
74）嘉实财富管理有限公司
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
联系人：余永健
电话：010-85097570
客服电话：400-021-8850
网址：www.harvestwm.cn
75）天相投资顾问有限公司
办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人：林义相
联系人：潘惠君
电话：010-66045776
客服电话：010-66045678
网址：http://www.jjm.com.cn
（3）基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构新增为丰利A的销售机构，并及时公告。
（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：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
电话：010-50938854
传真：010-50938991
联系人：徐盖
（三）律师事务所和经办律师
名称：上海市通力律师事务所
住所：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：吕红、黎明
联系人：黎明
（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：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：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
电话：（021）23238888
传真：（021）23238000
经办注册会计师：薛竞、周祎
联系人：周祎

四、基金份额的分级

（一）基金份额分级
本基金《基金合同》生效之日起3年内，本基金的基金份额划分为丰利 A、丰利 B两级份额，所募集的基金资产合并运作。
1、基金份额配比
丰利A、丰利B的份额配比原则上不超过3∶1。
本基金募集设立时，丰利A、丰利B的份额配比将不超过3∶1。
本基金在分级基金运作期内，丰利A自《基金合同》生效之日起每满6个月开放一次，丰利B封闭运作并上市交易。在丰利A的每次开放日，基金管理人将对丰利A进行基金份额折算，丰利A的基金份额净值调整为1.0000元，基金份额持有人持有的丰利A份额数按折算比例相应增减。为此，在丰利A的单个开放日，如果丰利A没有赎回或者净赎回份额极小，丰利A、丰利B在该次开放日后的份额配比可能会出现大于3∶1的情形；如果丰利A的净赎回份额较多，丰利A、丰利B在该次开放日后的份额配比可能会出现小于3∶1的情形。
2、丰利A的运作
（1）收益率
丰利A根据《基金合同》的规定获取约定收益，其收益率将在每个开放日设定一次并公告。计算公式为：
丰利A的年收益率（单利）＝1.35×1年期银行定期存款利率
丰利A的年收益率计算按照四舍五入的方法保留到百分数的小数点后第2位。
在《基金合同》生效日当日，基金管理人将根据届时中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率设定丰利A的首次年收益率；在丰利A的每个开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率重新设定丰利A的年收益率。
例1：在本基金基金合同生效日，如果1年期银行定期存款利率为3.5%，则丰利A的年收益率（单利）为：
丰利A的年收益率（单利）＝1.35×3.5%＝4.73%
（2）开放日
丰利A在《基金合同》生效后每满6个月开放一次，接受投资者的申购与赎回。
丰利A的开放日为自《基金合同》生效之日起每满6个月的最后一个工作日。
因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回的，开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。
丰利A的第一次开放日为《基金合同》生效日至6个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；第二次开放日为《基金合同》生效之日至12个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；以此类推。如，本基金基金合同已于2011年11月23日生效，基金合同生效之日起满6个月、满12个月、满18个月的日期分别为2012年5月22日、2012年11月22日、2013年5月22日，以此类推。假设2013年5月22日为非工作日，在其之前的最后一个工作日为2013年5月20日，则第一次开放日为2013年5月20日。其他各个开放日的计算类同。
（3）基金份额折算
本基金《基金合同》生效之日起每满6个月的最后一个工作日，基金管理人将对丰利A进行基金份额折算，丰利A的基金份额净值调整为1.0000元，基金份额持有人持有的丰利A份额数按折算比例相应增减。
丰利A的基金份额折算基准日与开放日为同一个工作日。
丰利A的基金份额折算具体见基金管理人届时发布的相关公告。
（4）规模限制
本基金在分级基金运作期内，丰利A的份额余额原则上不得超过3倍丰利B的份额余额。具体规模限制及其控制措施见本《招募说明书》、《发售公告》以及基金管理人发布的其他相关公告。
3、丰利B的运作
（1）丰利B封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回。
丰利B的封闭期为自《基金合同》生效之日起至3年后对应日止。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。
（2）本基金《基金合同》生效后3个月内，在符合上市条件的情况下，丰利B将申请在深圳证券交易所上市交易。本基金的丰利B份额已于2012年2月20日在深圳证券交易所上市交易。
（3）本基金在扣除丰利A的本金及应计收益后的全部剩余资产归丰利B享有，亏损以丰利B的资产净值为限由丰利B承担。
4、基金份额净值计算
本基金的基金份额净值计算公式如下：
T日基金份额净值＝T日闭市后的基金资产净值/T日基金份额的余额数量
本基金在分级基金运作期内，T日基金份额的余额数量为丰利A和丰利B的份额总额；本基金根据《基金合同》的约定转换为上市开放式基金（LOF）后，T日基金份额的余额数量为该LOF基金的份额总额。
本基金基金份额净值的计算，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
本基金《基金合同》生效后，截止丰利A的某一开放日或者基金转换时的份额转换基准日（T日），设Ta为自丰利A上一次开放日（如T日为第一次开放日，则为基金成立日）至T日的运作天数，NVr为T日闭市后的基金资产净值，Far为T日丰利A的份额余额，Fb为T日丰利B的份额余额， NAVar为T日丰利A的基金份额净值，r为在丰利A上一次开放日（如T日为第一次开放日，则为基金成立日）设定的丰利A的年收益率。
1）如果T日闭市后的基金资产净值大于或等于“1.00元乘以T日丰利A的份额余额加上T日全部丰利A份额应计收益之和”，则：

[illegible]

以上各式中，运作当年实际天数指丰利A上一次开放日（如T日为第一次开放日，则为基金成立日）所在年度的实际天数，下同。

[illegible]

丰利A、丰利B的基金份额净值的计算，保留到小数点后8位，小数点后第9位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。
例2：本基金《基金合同》生效后3年期届满日，设自丰利A上一次开放日起的运作天数为182天，基金运作当年的实际天数为365天，基金资产净值为52亿元，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的基金份额净值计算如下：

[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。

[illegible]

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《基金合同》生效后3 年期届满时的基金转换见招募说明书第十二部分及基金管理人发布的相关公告。

五、基金的名称

本基金名称：天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）。

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11月21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届时发布的相关公告。
丰利A已于2014年11月21日进行最后一次折算，折算后本基金已于2014年11月24日完成运作方式的转换并更名为“天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）。
（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，暂停丰利B的上市交易等业务，具体详见基金管理人发布的相关公告。
（六）基金份额折算的公告
1、基金份额折算方案须最迟于实施日前2日在指定媒介公告。
2、基金份额折算结束后，基金管理人应在2日内在指定媒介公告。

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在《基金合同》生效后三个月内开始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。
丰利B基金份额于2012年2月20日在深圳证券交易所上市交易并于2014年11月24日终止上市。本基金完成基金转型后，天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）已于2014年12月3日开始在深圳证券交易所上市交易。
（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2015年12月22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 2015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	1,565,020,191.60	96.17
	其中：债券	1,565,020,191.60	96.17
	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	28,465,390.73	1.75
6	其他各项资产	33,924,603.16	2.08
7	合计	1,627,410,185.49	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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	60,003,000.00	3.77
	其中：政策性金融债	60,003,000.00	3.77
4	企业债券	924,764,805.50	58.12
5	企业短期融资券	471,391,000.00	29.63
6	中期票据	103,915,000.00	6.53
7	可转债	4,946,386.10	0.31
8	其他	-	-
9	合 计	1,565,020,191.60	98.36

注：可转债项下包含可交换债1,253,278.00元。

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	1480458	14渝港投债	1,000,000	105,980,000.00	6.66
2	011572001	15招铝SCP001	1,000,000	100,010,000.00	6.29
3	011599692	15陕延油SCP003	1,000,000	99,970,000.00	6.28
4	122126	11庞大02	800,000	83,960,000.00	5.28
5	122776	11新光债	800,000	82,352,000.00	5.18

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股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
10、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。
11、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	1,849.56
2	应收证券清算款	590,834.35
3	应收股利	-
4	应收利息	32,030,480.10
5	应收申购款	1,301,439.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,924,603.16

（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
金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113008	电气转债	3,167,272.50	0.20

（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
本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。
（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2015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%
2014/01/01-2014/11/24	24.01%	0.50%	7.57%	0.10%	16.44%	0.40%
自基金合同生效日（2011/11/23）-2014/11/24	56.79%	0.49%	4.82%	0.09%	51.97%	0.40%
自基金合同转换日（2014/11/25）-2014/12/31	-0.95%	0.65%	-0.96%	0.15%	0.01%	0.50%
2015/01/01-2015/09/30	8.28%	0.10%	2.34%	0.08%	5.94%	0.02%
自基金合同转换日（2014/11/25）-2015/09/30	7.25%	0.25%	1.36%	0.10%	5.89%	0.15%

注：本基金合同于2011年11月23日生效，本基金于2014年11月24日三年封闭期届满，封闭期届满后本基金自动转换为上市开放式基金（LOF）。

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