

(上接A39版)

地址: www.fstspjs.com.cn
(101) 北京隆上隆信基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内03室
办公地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内03室
法定代表人: 安立欣
电话: 15600035877
联系人: 张林
客服电话: 400-080-5828
网址: www.lslz.com.cn
(102) 上海大智慧基金销售有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区郭守敬路46号浦东软件园14幢22201-133座
办公地址: 上海市杨浦区国权路429号由世纪广场1号楼
法定代表人: 张长虹
电话: 15901082625
联系人: 陈皓华
客服电话: 021-20211997
网址: www.gw.com.cn
(103) 申银万国期货有限公司
注册地址: 上海市东方路800号7、8、10楼
办公地址: 上海浦东新区东方路800号安宝大厦7、8、10楼
法定代表人: 李建中
联系人: 史文斐
电话: 13701852001
客服电话: 400-888-7988
网址: www.sywq.com.cn
(104) 上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址: 上海市黄浦区西藏南路760号602-115室
办公地址: 上海市黄浦区延安东路4号凯石大厦4F
法定代表人: 陈昊武
联系人: 王宇辉
电话: 021-63333319
客服电话: 400-643-3389
网址: www.vstonewealth.com
(105) 东海期货有限责任公司
注册地址: 江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号
办公地址: 上海市浦东新区东方路1029号东海证券大厦6楼
法定代表人: 陈兆康
联系人: 李天雨
电话: 021-68757010
客服电话: 400-888-5888
网址: www.qh18.com.cn
(106) 深圳国信基金销售有限公司
注册地址: 深圳市福田区香花路招商证券广东商务大厦8楼A-1
办公地址: 大连市中山路150号1501-A-3-1
法定代表人: 潘宏升
联系人: 王阳笛
电话: 13522300098
客服电话: 4007-993-688
网址: www.fundying.com
(107) 上海朝辰永泰基金销售有限公司
注册地址: 上海市浦东新区张江路680号4号楼2楼
办公地址: 上海市浦东新区张江路680号4号楼2楼
法定代表人: 廖冰
联系人: 陆纪青
电话: 15902133004
客服电话: 400-098-7172
网址: www.99fund.com
(108) 嘉实基金(天津)基金销售有限公司
注册地址: 天津市南开区南开三马路与银河国际交口悦购广场1号楼2503室
办公地址: 天津市南开区南开三马路与银河国际交口悦购广场1号楼2503室
法定代表人: 孙伟
电话: 15610846151
联系人: 孙颖
客服电话: 4007-993-688
网址: www.fund123.com
(109) 上海聚信基金销售有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路700号5层01_02_03室
办公地址: 上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼8层
电话: 021-50810687
联系人: 刘磊
客服电话: 400-025-6569
网址: www.juixin.com.cn
(110) 天津万家财富资产管理有限公司
注册地址: 天津自贸试验区(中心商务区)瑞泰大道198号滨海新区大厦公寓2-2413室
办公地址: 北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层
法定代表人: 李修弟
电话: 13811914657
联系人: 杨雪
客服电话: 010-59013828
网址: www.wjasset.com
(111) 上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址: 上海市虹口区东大名路687号15楼268室
办公地址: 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人: 毛淑平
电话: 010-88066632
联系人: 仲明
客服电话: 400-871-7666
网址: www.huaxia.com.cn
(112) 和耕有泰基金销售有限公司
注册地址: 郑州市郑东新区东风东大街、康宁北6号楼楼B02、003房间
办公地址: 北京市朝阳区酒仙桥路6号院国际电子地连
法定代表人: 李贤章
电话: 13810222517
联系人: 董亚茹
客服电话: 400-360-0000
网址: www.hqcp.com.cn
(113) 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
办公地址: 中国(上海)浦东新区源深路308号张江世纪城金融广场3号楼4楼
法定代表人: 戴雁装
电话: wanggang@cn38.com
联系人: 王宇
客服电话: 010-280-1515
网址: www.zhengtongfund.com
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调整为基金的销售机构,并提前公告。
(二) 注册和登记机构
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: 010-50938891
联系人: 徐蓓
(三) 律师事务所和经办律师
名称: 上海通力律师事务所
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 31258666
传真: 021 31350600
经办律师: 吕红、黎明
联系人: 陈皓华
(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 23238800
传真: 021 23238801
联系人: 陈皓华
(五) 基金名称
本基金名称: 天弘丰利债券型证券投资基金(LOP)。六、基金的投资
本基金类型: 债券型。
七、非利A的基金份额折算
本基金在分级基金运作期内,非利A将按照以下规则进行基金份额折算。
(一) 折算日期
本基金在分级基金运作期内,非利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。
非利A的基金份额折算基准日与其开放日为同一工作日。
(二) 折算对象
基金份额折算基准日登记在册的非利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
折算日当日,非利A的基金份额净值调整为1.000元,基金份额持有人持有的非利A的基金份额按照折算比例相应增减。
非利A的基金份额折算公式如下:
非利A的折算比例=折算日折算前非利A的基金份额净值/1.0000
非利A经折算后的份额数=折算前非利A的份额数×非利A的折算比例
非利A经折算后的份额数向下取整至小数点后五位的方式保留小数点后两位,由此产生的误差计入基金财产。
在实施基金份额折算时,折算日折算前非利A的基金份额净值、非利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。
(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基金业务的平稳运行,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,暂停非利A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. 基金管理人须提前最近于折算日前2日指定媒介公告。
2. 基金份额折算结束后,基金管理人应在2个工作日内指定媒介公告。
(七) 基金份额折算的其他事宜
本基金非利A已于2015年11月21日完成最后一次折算,折算后本基金已于2015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(LOP)”。
八、基金的投资范围
(一) 上市交易的投资品种
非利B在《基金合同》生效后3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上市开放式基金(LOF)份额,本基金将投资于上市开放式基金(LOF)之日起30日内继续在深圳证券交易所上市交易。
在确定上述交易时间后,基金管理人应在上述3个工作日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告。
非利B的份额于2015年2月20日在深圳证券交易所上市交易并自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. 非利A上市首日的开盘参考价为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,基金上市首日的开盘参考价为前一工作日的基金份额参考净值。
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. 本基金买入申报最小数量为10份或0.001元人民币。
5. 本基金申报价格最小变动单位为0.0001元人民币。
6. 本基金上市交易规则(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,指非利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,指非利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,为利A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,指非利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相关规定等相关内容进行调整的,本基金(本基金合同)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)后,非利A、非利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) 基金转型时非利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年期届满日与非利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非利A的基金份额持有人于非工作日,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,本基金转换为上市开放式基金(LOF)后的基金份额净值调整为1.0000元。
在份额转换基准日之后,以份额转换后1.0000元的基金份额净值为基准,非利A、非利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:
非利A(或非利B)的转换比率=份额转换基准日非利A(或非利B)的基金份额净值/1.0000
非利A(或非利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非利A(或非利B)的份额数×非利A(或非利B)的转换比率
在进行份额转换时,非利A、非利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;非利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,非利A(或非利B)的转换比率、非利A(或非利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
非利A、非利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) 本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,基金管理人将按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,并报告中国证监会备案;
(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) 非利A、非利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,并报告中国证监会备案。
(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、可转债、地方政府债、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、中国证监会允许基金投资的其它固定收益类金融工具(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。本基金直接通过二级市场买入股票、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、所持股票限售及派发、权证行权所形成的股票,以及所持股票和可分离债券分离形成的权证等,以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其它权益类金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。以上三类资产的投资和赎回等资产,本基金将在其可交易之日起30个交易日之内完成。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入本基金投资。
本基金对债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中,投资于信用债券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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金对股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产净值的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)、资产支持证券等金融债、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
(一) 投资策略
本基金通过宏观经济发展、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,采用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
本基金采取相对稳定的投资管理策略,在自上而下确定大类资产配置和信用债券类金融工具的配置比例,动态调整固定收益类资产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。
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信用债券类金融工具到期收益率、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趋势、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相结合的方法,对各类信用债券金融工具进行择优配置。
(二) 久期策略
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上的预期,动态调整组合的久期。当前预期收益率曲线下降时,适当提高组合久期,以分享债券市场上长期的收益;当前预期收益率曲线上升时,适当降低组合久期,以规避债券市场下跌的风险。
(三) 收益曲线策略
本基金除考虑系统性的利率风险对收益曲线形状的影响之外,还将考虑债券市场微观因素对收益曲线的影响,如短期利率预期、新发行债、回购及再融资利率等,形成一定阶段内的收益率曲线变动趋势的预期,并据此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的债券因素、市场供求关系和流动性变化等因素的研判,确定信用债券的资产配置和各信用等级信用债券所占的投资比例。
(四) 信用风险分散
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价结果,选取具有优势优势和获利机会的优质信用债券品种进行投资。
(五) 信用债券品种选择
本基金根据信用债券市场收益率曲线,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、期限等因素,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票面特征、特性、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,并且具备强基本面支撑、具有较强盈利能力、成长前景好、偿债能力强、具有较高流动性、以合理价格买入并持有,根据内含收益率、折溢价水平、久期、凸性等指标对可转换公司债券投资价值进行跟踪评价。此外,本基金将通过分析不同市场环境条件下可转换公司债券转股和赎回的相对价值,通过对转股价格的弹性与转债的合理定价,力求选择转债市场低估值品种,进而构建本基金可转换公司债券的投资组合。
十三、业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证综合债指数。
中证综合债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)不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期),是中国目前最权威、应用最广泛的指数。中证综合指数的构成品种全面覆盖了基金的投资范围,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、更能为市场参与者接受的业绩比较基准推出,或者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,基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后,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,非利A为低风险、收益相对稳定的基金份额;非利B为较高风险、较高收益的基金份额。
十五、基金投资组合
基金管理人将本着谨慎及诚实信用原则,确保不存在虚假记载、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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年6月15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2018年3月31日,本报告中所列数据与经审计,以下内容摘自本基金2018年度季报。
1. 报告期末基金资产净值情况

金额单位:人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
2	债权投资	—	—
3	金融投资	10,004,000.00	5.04
4	固定收益类资产	125,727,726.00	63.40
5	金融衍生品投资	30,169,000.00	15.21
6	买入返售金融资产	30,265,000.00	15.28
7	其他资产	—	—
8	其他负债	—	—
9	其他	—	—
10	合计	196,666,826.00	99.16

金额单位:人民币元			
序号	债券代码	债券名称	数量(份)
1	139303	44附息国债	200,000
2	139303	13年附息国债	400,000
3	139306	13年国债	400,000
4	129446	13年国债	300,000
5	10136606	13年国债	100,000

金额单位:人民币元			
序号	存出保证金	金额	占基金总资产的比例(%)
1	存出清算资金	5,126.77	—
2	应收证券清算款	—	—
3	应收利息	4,142,480.02	—
4	应收股利	66,285.54	—
5	应收申购款	—	—
6	其他应收款	5,097.08	—
7	待摊费用	—	—
8	其他	—	—
9	合计	4,218,989.41	—

金额单位:人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
2	债权投资	—	—
3	金融投资	196,666,826.00	99.16
4	固定收益类资产	196,666,826.00	99.16
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
7	其他资产	2,214,083.69	1.09
8	其他负债	4,218,989.41	2.08
9	其他	202,100,469.04	100.00
10	合计	202,100,469.04	100.00

3. 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
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
金额单位:人民币元
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 国债投资 500,100.00 0.25
2 央行票据 — —
3 金融债 10,004,000.00 5.04
其中:政策性金融债 10,004,000.00 5.04
4 企业债 125,727,726.00 63.40
5 中期票据 30,169,000.00 15.21
6 短期融资券 30,265,000.00 15.28
7 可转债(可交换债) — —
8 其他 — —
9 其他 — —
10 合计 196,666,826.00 99.16
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五名债券投资明细
金额单位:人民币元
序号 债券代码 债券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 139303 44附息国债 200,000 10,700,000.00 5.34
2 139303 13年附息国债 400,000 16,240,000.00 8.19
3 139306 13年国债 400,000 16,140,000.00 8.14
4 129446 13年国债 300,000 12,222,000.00 6.16
5 10136606 13年国债 100,000 10,156,000.00 5.12
6. 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序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
11.1 报告期内未发现本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,未发现报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
11.2 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的备选股票库的情况。
11.3 其他资产构成
金额单位:人民币元
序号 名称 金额
1 存出保证金 5,126.77
2 应收证券清算款 —
3 应收利息 4,142,480.02
4 应收股利 66,285.54
5 应收申购款 —
6 其他应收款 5,097.08
7 待摊费用 —
8 其他 —
9 合计 4,218,989.41
11.4 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。
11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。
11.6 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误差。
十六、基金的投资
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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2015年11月23日,本基金业绩数据截至2018年3月31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
金额单位:人民币元
阶段 净值增长率(A) 净值增长率标准差(A/2) 业绩比较基准收益率(B) 业绩比较基准收益率标准差(B/2) ①-③ ②-④
自基金合同生效日(2015/11/23)至2017/12/31 0.97% 0.11% 0.07% 0.11% 0.10% 0.00%
自基金合同生效日(2015/11/23)至2018/12/31 16.70% 0.26% 0.37% 0.06% 16.33% 0.29%
自基金合同生效日(2015/11/23)至2018/12/31 73.01% 0.61% -3.75% 0.08% 11.65% 0.53%
自基金合同生效日(2015/11/23)至2018/12/31 24.01% 0.50% 7.57% 0.10% 16.44% 0.40%
自基金合同生效日(2015/11/23)至2018/12/31 56.70% 0.49% 4.82% 0.09% 51.97% 0.40%
自基金合同生效日(2015/11/23)至2018/12/31 -0.96% 0.65% -0.96% 0.15% 0.01% 0.50%
自基金合同生效日(2015/11/23)至2018/12/31 10.64% 0.10% 4.19% 0.08% 6.27% 0.02%
自基金合同生效日(2015/11/23)至2018/12/31 21.0% 0.09% -1.63% 0.09% 3.78% -0.04%
自基金合同生效日(2015/11/23)至2018/12/31 2.90% 0.02% -3.38% 0.00% 6.04% -0.04%
自基金合同生效日(2015/11/23)至2018/12/31 1.40% 0.03% 1.13% 0.04% 0.27% -0.01%
自基金合同生效日(2015/11/23)至2018/12/31 16.46% 0.12% -0.82% 0.08% 17.27% 0.05%
注:本基金合同于2015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》生效与基金相关的信息披露费;
5. 《基金合同》生效与基金相关的会计师事务所、律师事务所和审计费;
6. 基金份额持有人大会费;
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。
本基金上述费用均从基金财产中列支,按实际支出金额从基金财产中扣除。
(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为每日应计提的管理费
E为前一日基金资产净值
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,经基金托管人复核无误后于次月月初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时,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,经基金托管人复核无误后于次月月初3个工作日内从基金财产中扣除,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时,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用于本基金的营销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照前一日基金资产净值的0.35%年费率计提。基金销售服务费的计算方法如下:
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,经基金托管人复核无误后于次月月初3个工作日内从基金财产中扣除,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时,顺延至最近可支付日支付。
上述1-3项基金费用,由基金管理人向基金托管人支付。
(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均不列入基金费用。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资产中支付。
(四) 费用调整
基金管理人经与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、基金销售费率、基金销售服务费、基金托管费率或基金销售服务费等费率,须召开基金份额持有人大会审议,并经基金份额持有人大会决议。
基金管理人必须遵守《证券投资基金信息披露管理办法》、《流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的要求。结合本基金管理人对本基金发展情况的管理,对本基金管理人于2018年1月6日公告的《天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:
1. 更新了“重要提示”中相关内容;
2. 更新了“二、释义”中相关内容;
3. 更新了“三、基金管理人”中相关内容;
4. 更新了“四、基金托管人”中相关内容;
5. 更新了“五、相关服务机构”中相关内容;
6. 更新了“六、基金的投资”中相关内容;
7. 更新了“七、基金的投资”中相关内容;
8. 更新了“八、基金的投资”中相关内容;
9. 更新了“九、基金的投资”中相关内容;
10. 更新了“十、基金的投资”中相关内容;
11. 更新了“十一、基金的投资”中相关内容;
12. 更新了“十二、基金的投资”中相关内容;
13. 更新了“十三、基金的投资”中相关内容;
14. 更新了“十四、基金的投资”中相关内容;
15. 更新了“十五、基金的投资”中相关内容;
16. 更新了“十六、基金的投资”中相关内容;
17. 更新了“十七、基金的投资”中相关内容;
18. 更新了“十八、基金的投资”中相关内容;
19. 更新了“十九、基金的投资”中相关内容;
20. 更新了“二十、基金的投资”中相关内容;
21. 更新了“二十一、基金的投资”中相关内容;
22. 更新了“二十二、基金的投资”中相关内容;
23. 更新了“二十三、基金的投资”中相关内容;
24. 更新了“二十四、基金的投资”中相关内容;
25. 更新了“二十五、基金的投资”中相关内容;
26. 更新了“二十六、基金的投资”中相关内容;
27. 更新了“二十七、基金的投资”中相关内容;
28. 更新了“二十八、基金的投资”中相关内容;
29. 更新了“二十九、基金的投资”中相关内容;
30. 更新了“三十、基金的投资”中相关内容;
31. 更新了“三十一、基金的投资”中相关内容;
32. 更新了“三十二、基金的投资”中相关内容;
33. 更新了“三十三、基金的投资”中相关内容;
34. 更新了“三十四、基金的投资”中相关内容;
35. 更新了“三十五、基金的投资”中相关内容;
36. 更新了“三十六、基金的投资”中相关内容;
37. 更新了“三十七、基金的投资”中相关内容;
38. 更新了“三十八、基金的投资”中相关内容;
39. 更新了“三十九、基金的投资”中相关内容;
40. 更新了“四十、基金的投资”中相关内容;
41. 更新了“四十一、基金的投资”中相关内容;
42. 更新了“四十二、基金的投资”中相关内容;
43. 更新了“四十三、基金的投资”中相关内容;
44. 更新了“四十四、基金的投资”中相关内容;
45. 更新了“四十五、基金的投资”中相关内容;
46. 更新了“四十六、基金的投资”中相关内容;
47. 更新了“四十七、基金的投资”中相关内容;
48. 更新了“四十八、基金的投资”中相关内容;
49. 更新了“四十九、基金的投资”中相关内容;
50. 更新了“五十、基金的投资”中相关内容;
51. 更新了“五十一、基金的投资”中相关内容;
52. 更新了“五十二、基金的投资”中相关内容;
53. 更新了“五十三、基金的投资”中相关内容;
54. 更新了“五十四、基金的投资”中相关内容;
55. 更新了“五十五、基金的投资”中相关内容;
56. 更新了“五十六、基金的投资”中相关内容;
57. 更新了“五十七、基金的投资”中相关内容;
58. 更新了“五十八、基金的投资”中相关内容;
59. 更新了“五十九、基金的投资”中相关内容;
60. 更新了“六十、基金的投资”中相关内容;
61. 更新了“六十一、基金的投资”中相关内容;
62. 更新了“六十二、基金的投资”中相关内容;
63. 更新了“六十三、基金的投资”中相关内容;
64. 更新了“六十四、基金的投资”中相关内容;
65. 更新了“六十五、基金的投资”中相关内容;
66. 更新了“六十六、基金的投资”中相关内容;
67. 更新了“六十七、基金的投资”中相关内容;
68. 更新了“六十八、基金的投资”中相关内容;
69. 更新了“六十九、基金的投资”中相关内容;
70. 更新了“七十、基金的投资”中相关内容;
71. 更新了“七十一、基金的投资”中相关内容;
72. 更新了“七十二、基金的投资”中相关内容;
73. 更新了“七十三、基金的投资”中相关内容;
74. 更新了“七十四、基金的投资”中相关内容;
75. 更新了“七十五、基金的投资”中相关内容;
76. 更新了“七十六、基金的投资”中相关内容;
77. 更新了“七十七、基金的投资”中相关内容;
78. 更新了“七十八、基金的投资”中相关内容;
79. 更新了“七十九、基金的投资”中相关内容;
80. 更新了“八十、基金的投资”中相关内容;
81. 更新了“八十一、基金的投资”中相关内容;
82. 更新了“八十二、基金的投资”中相关内容;
83. 更新了“八十三、基金的投资”中相关内容;
84. 更新了“八十四、基金的投资”中相关内容;
85. 更新了“八十五、基金的投资”中相关内容;
86. 更新了“八十六、基金的投资”中相关内容;
87. 更新了“八十七、基金的投资”中相关内容;
88. 更新了“八十八、基金的投资”中相关内容;
89. 更新了“八十九、基金的投资”中相关内容;
90. 更新了“九十、基金的投资”中相关内容;
91. 更新了“九十一、基金的投资”中相关内容;
92. 更新了“九十二、基金的投资”中相关内容;
93. 更新了“九十三、基金的投资”中相关内容;
94. 更新了“九十四、基金的投资”中相关内容;
95. 更新了“九十五、基金的投资”中相关内容;
96. 更新了“九十六、基金的投资”中相关内容;
97. 更新了“九十七、基金的投资”中相关内容;
98. 更新了“九十八、基金的投资”中相关内容;
99. 更新了“九十九、基金的投资”中相关内容;
100. 更新了“一百、基金的投资”中相关内容;
十八、基金管理人承诺
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。
十九、基金托管人承诺
基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责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。
二十、基金份额持有人承诺
基金份额持有人承诺以诚实信用、勤勉尽责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。
二十一、基金销售机构承诺
基金销售机构承诺以诚实信用、勤勉尽责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。
二十二、基金服务机构承诺
基金服务机构承诺以诚实信用、勤勉尽责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。
二十三、基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金服务机构的承诺
基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金服务机构承诺以诚实信用、勤勉尽责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。
二十四、基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金服务机构的承诺
基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金服务机构承诺以诚实信用、勤勉尽责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。
二十五、基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金服务机构的承诺
基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金服务机构承诺以诚实信用、勤勉尽责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。
二十六、基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金服务机构的承诺
基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金服务机构承诺以诚实信用、勤勉尽责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。
二十七、基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金服务机构的承诺