

天弘同利债券型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)摘要(2017年第2期)

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

日期：二〇一七年十月

重要提示

天弘同利债券型证券投资基金(LOF)(以下简称基金或本基金)于2013年3月13日经中国证监会证监许可[2013]245号文核准募集。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。本基金的基金合同于2013年9月17日正式生效。根据《基金合同》的有关规定,《基金合同》生效之日起3年内,本基金的基金份额划分为同利A、同利B两级份额,同利A自《基金合同》生效之日起每满一年开放一次,同利B封闭运作并上市交易;本基金《基金合同》生效后3年期届满,已自动转换为上市开放式基金(LOF),基金名称已变更为天弘同利债券型证券投资基金(LOF),同利A、同利B的基金份额已转换为上市开放式基金(LOF)份额。本基金转换完成后,《基金合同》中除仅适用于天弘同利分级债券的条款外,继续适用于转换后的天弘同利债券型证券投资基金(LOF)。本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。投资有风险,投资者认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。风险提示:证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。本基金投资于固定收益类金融工具,不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购或增发新股投资。本基金对固定收益类证券的投资比例不得低于基金资产的80%。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,同利A为低风险、收益相对稳定的基金份额,但并非保本基金;同利B为较高风险、较高收益的基金份额。投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构购买基金。基金的过往业绩并不预示其未来表现。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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的买者自负原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化、基金份额上市交易价格波动引致的投资风险,由投资者自行承担。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。基金招募说明书自基金合同生效之日起,每6个月更新一次,并于每6个月结束之日后的45日内公告。本招募说明书所载内容截止日为2017年9月17日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30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:天弘基金管理有限公司住所:天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号办公地址:天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层成立日期:2004年11月8日法定代表人:井贤栋联系电话:(022)83310208组织形式:有限责任公司注册资本及股权结构:天弘基金管理

有限公司（以下简称公司或本公司）经中国证券监督管理委员会批准（证监基金字[2004]164号），于2004年11月8日成立。公司注册资本为人民币5.143亿元，股权结构为：

股东名称 股权比例

浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司 51%

天津信托有限责任公司 16.8%

内蒙古君正能源化工集团股份有限公司 15.6%

芜湖高新投资有限公司 5.6%

新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙） 3.5%

新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙） 2%

新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙） 2%

新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙） 3.5%

合计 100%

（二）主要人员情况

1、董事会成员基本情况

井贤栋先生，董事长，硕士研究生。历任太古饮料有限公司财务总监、广州百事可乐有限公司首席财务官、阿里巴巴（中国）信息技术有限公司财务副总裁、支付宝（中国）网络技术有限公司首席财务官，浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司首席运营官，现任浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司CEO。卢信群先生，副董事长，硕士研究生。历任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、副总经理、财务总监、董事会秘书，北京博晖创新光电技术股份有限公司监事。现任北京博晖创新光电技术股份有限公司董事长、总经理，君正国际投资（北京）有限公司董事，河北大安制药有限公司董事。黄浩先生，董事，大学本科。历任中国建设银行总行计财部副处长，处长，部门副总经理、中德住房储蓄银行行长、中国建设银行总行网络金融部总经理。现任浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司副总裁。屠剑威先生，董事，硕士研究生。历任中国工商银行浙江省分行营业部法律事务处案件管理科副科长、香港永亨银行有限公司上海分行法律合规监察部经理、花旗银行（中国）有限公司合规部助理总裁、永亨银行（中国）有限公司法律合规部主管。现任浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司法务及合规部高级研究员。付岩先生，董事，大学本科。历任北洋（天津）物产集团有限公司期货部交易员，中国经济开发信托投资公司天津证券部投资部职员，顺驰（中国）地产有限公司资产管理部高级经理、天津信托有限责任公司投资银行部项目经理。现任天津信托有限责任公司自营业务部总经理。郭树强先生，董事，总经理，硕士研究生。历任华夏基金管理有限公司交易主管、基金经理、研究总监、机构投资总监、投资决策委员会委员、机构投资决策委员会主任、公司管委会委员、公司总经理助理。现任本公司总经理。魏新顺先生，独立董事，大学本科。历任天津市政府法制办执法监督处副处长，天津市政府法制办经济法规处处长，天津达天律师事务所律师。现任天津英联律师事务所主任律师。张军先生，独立董事，博士。现任复旦大学经济学院院长，中国经济研究中心主任。贺强先生，独立董事，本科。现任中央财经大学金融学院教授。

2、监事会成员基本情况

李琦先生，监事会主席，硕士研究生。历任天津市民政局事业处团委书记，天津市人民政府法制办公室、天津市外经贸委办公室干部，天津信托有限责任公司条法处处长、总经理助理兼条法处处长、副总经理，本公司董事长。张杰先生，监事，注册会计师、注册审计师。现任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，锡林浩特市君正能源化工有限责任公司董事长，锡林郭勒盟君正能源化工有限责任公司执行董事、总经理，内蒙古君正化工有限责任公司监事，乌海市君正矿业有限责任公司监事，内蒙古中鑫能源有限公司董事，内蒙古坤德物流股份有限公司监事。方隽先生，监事，硕士研究生。历任厦门中恒信会计师事务所审计部门经理、福建立信闽都会计师事务所副主任会计师、立信会计师事务所厦门分所副主任会计师。现任芜湖高新投资有限公司总经理。韩海潮先生，监事，硕士研究生。历任三峡证券天津白堤路营业部、勤俭道营业部信息技术部经理，亚洲证券天津勤俭道营业部营运总监。现任本公司运营总监、信息技术总监。张牡霞女士，监事，硕士研究生。历任新华社上海证券报财经要闻部记者、天

弘基金市场部电子商务专员、电子商务部业务拓展主管、总经理助理，现任本公司互联网金融业务部总经理。付颖女士，监事，硕士研究生。历任天弘基金监察稽核部信息披露专员、法务专员、合规专员、高级合规经理、部门主管。现任本公司监察稽核部总经理。

3、高级管理人员基本情况

郭树强先生，董事，总经理，简历参见董事会成员基本情况。陈钢先生，副总经理，硕士研究生。历任华龙证券公司固定收益部高级经理，北京宸星投资管理公司投资经理，兴业证券公司债券总部研究部经理，银华基金管理有限公司机构理财部高级经理，中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。

2011年7月份加盟本公司，现任公司副总经理、资深基金经理、固定收益总监，分管公司固定收益投资业务。周晓明先生，副总经理，硕士研究生。历任中国证券市场研究院设计中心及其下属北京标准股份制咨询公司经理，万通企业集团总裁助理，中工信托有限公司投资部副总，国信证券北京投资银行一部经理，北京证券投资银行部副总，嘉实基金市场部副总监、渠道部总监，香港汇富集团高级副总裁，工银瑞信基金市场部副总监，嘉实基金产品和营销总监，盛世基金拟任总经理。2011年8月加盟本公司，同月被任命为公司首席市场官，现任公司副总经理，分管公司电子商务及产品业务。熊军先生，副总经理，财政学博士。历任中央教育科学研究所助理研究员，国家国有资产管理局主任科员、副处长，财政部干部教育中心副处长，全国社保基金理事会副处长、处长、副主任、巡视员。2017年3月加盟本公司，任命为公司首席经济学家，现任公司副总经理，分管智能投资部及养老金业务。童建林先生，督察长，大学本科，高级会计师。历任当阳市产权证券交易中心财务部经理、副总经理，亚洲证券有限责任公司宜昌总部财务主管、宜昌营业部财务部经理、公司财务会计总部财务主管，华泰证券有限责任公司上海总部财务项目主管，本公司基金会计、监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理。现任本公司督察长。

4、本基金基金经理

陈钢先生，工商管理硕士，15年证券从业经验。历任华龙证券公司固定收益部高级经理，北京宸星投资管理公司投资经理，兴业证券公司债券总部研究部经理，银华基金管理有限公司机构理财部高级经理，中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2011年7月加盟本公司，历任天弘永利债券型证券投资基金基金经理（2011年11月至2015年4月期间）、天弘债券型发起式证券投资基金基金经理（2013年8月-2016年5月期间）、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金经理（2015年5月至2017年1月期间）、天弘弘利债券型证券投资基金基金经理（2013年9月至2017年4月期间）、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金基金经理（2015年10月至2017年6月期间）。现任本公司副总经理、固定收益总监，天弘添利债券型证券投资基金（LOF）基金经理、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）基金经理、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）基金经理、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金基金经理、天弘乐享保本混合型证券投资基金基金经理。刘洋女士，清华大学硕士学位，4年证券从业经验。

2013年1月加盟天弘，历任交易员、研究员，现任天弘添利债券型证券投资基金(LOF)基金经理、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）基金经理、天弘债券型发起式证券投资基金基金经理、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

陈钢先生，本公司副总经理，投资决策委员会联席主席、固定收益总监，基金经理。熊军先生，本公司副总经理，投资决策委员会联席主席、公司首席经济学家。邓强先生，首席风控官。肖志刚先生，股票投资总监，基金经理。黄颖女士，研究总监。王登峰先生，固定收益部总经理，基金经理。钱文成先生，基金经理。刘冬先生，基金经理。陈国光先生，基金经理。姜晓丽女士，基金经理。王林先生，基金经理。上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

1、基本情况名称：中国工商银行股份有限公司住所：北京西城区复兴门内大街55号办公地址：北京西城区复兴门内大街55号法定代表人：易会满成立时间：1984年1月1日组织形式：股份有限公司注册资本：人民币35,640,625.71万元存续期间：持续经营批准设立机关及批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）基金托管业务批准文号：中国证监会和中国人民

银行证监基字【1998】3号联系人：郭明联系电话：（010）661057992、主要人员情况截至2016年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工190人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。3、基金托管业务经营情况作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承诚实信用、勤勉尽责的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2016年6月，中国工商银行共托管证券投资基金587只。自2003年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的51项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）基金销售机构

1、直销机构：

（1）天弘基金管理有限公司直销中心住所：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号办公地址：天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层法定代表人：井贤栋电话：（022）83865560 传真：（022）83865563 联系人：司媛客服电话：95046（2）天弘基金管理有限公司网上直销平台办公地址：北京市西城区月坛北街2号月坛大厦A座20层电话：（010）83571739 传真：（010）83571840 联系人：许丛立网址：www.thfund.com.cn（3）天弘基金管理有限公司北京分公司办公地址：北京市西城区月坛北街2号月坛大厦A座20层电话：（010）83571789 传真：（010）83571900 联系人：申向阳（4）天弘基金管理有限公司上海分公司办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号30层E-F单元电话：（021）50128808 传真：（021）50128801 联系人：涂远宏（5）天弘基金管理有限公司广州分公司办公地址：广州市天河区珠江东路6号广州周大福金融中心16层05室电话：（020）38927920 传真：（020）38927985 联系人：张欣露

2、其他销售机构

（1）中国工商银行股份有限公司住所：北京西城区复兴门内大街55号办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号法定代表人：易会满电话：010-66105799 传真：010-66107914 联系人：李鸿岩客服电话：95588 网站：www.icbc.com.cn（2）交通银行股份有限公司住所：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：牛锡明电话：021-58781234 传真：021-58408483 联系人：宋恒客服电话：95559 网站：www.bankcomm.com（3）中信银行股份有限公司住所：北京市东城区朝阳门大街8号富华大厦C座办公地址：北京市东城区朝阳门大街8号富华大厦C座法定代表人：李庆萍电话：010-89937325 传真：010-65550827 联系人：王晓琳客服电话：95558 网站：bank.ecitic.com（4）中国邮政储蓄银行股份有限公司住所：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：李国华联系人：李雪萍电话：010-68858095 传真：010-68858117 客服电话：95580 网站：www.psbc.com（5）东莞农村商业银行股份有限公司住所：广东省东莞市城区南城路2号办公地址：广东省东莞市城区南城路2号法定代表人：何沛良电话：0769-961122 传真：0769-22320896 联系人：杨亢客服电话：0769-961122 网站：www.drcbank.com（6）平安银行股份有限公司住所：深圳市深南东路5047号办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦9楼法定代表人：孙建一电话：021-50979356 传真：021-50979507 联系人：施艺帆客服电话：95511-3 网站：bank.pingan.com（7）杭州银行股份有限公司住所：杭州市庆春路46号办公地址：杭州市庆春路46号法定代表人：陈震山传真：0571-

85106576 联系人: 严峻客服电话: 400-8888-508 网站: www.hzbank.com.cn (8) 宁波银行股份有限公司住所: 宁波市鄞州区宁南南路 700 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: 于波涛客服电话: 96528、962528 网站: www.nbc.com.cn (9) 南京银行股份有限公司住所: 南京市中山路 288 号办公地址: 南京市中山路 288 号法定代表人: 林复电话: 025-86775335 联系人: 张小光客服电话: 40088-96400 网站: www.njcb.com.cn (10) 中泰证券股份有限公司注册地址: 山东省济南市经七路 86 号办公地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号 23 层法定代表人: 李玮电话: 021-20315255 传真: 021-20315137 联系人: 许曼华客户服务热线: 95538 网站: www.qlzq.com.cn (11) 光大证券股份有限公司注册地址: 上海市静安区新闻路 1508 号办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号法定代表人: 徐浩明电话: 021-22169999 传真: 021-22169134 联系人: 李芳芳客户服务热线: 400-8888-788、10108998 网站: www.ebscn.com (12) 中银国际证券有限责任公司注册地址: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层办公地址: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层法定代表人: 许刚电话: 021-20328704 传真: 021-50372474 联系人: 王炜哲客户服务热线: 400-620-8888 网站: www.bocichina.com.cn (13) 中航证券有限公司注册地址: 江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼办公地址: 江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座法定代表人: 杜航电话: 010-64818301 传真: 0791-86770178 联系人: 戴蕾客户服务热线: 400-886-6567 网站: www.avicsec.com (14) 世纪证券有限责任公司注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 41-42 层办公地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 41-42 层法定代表人: 卢长才电话: 0755-83199599 传真: 0755-83199545 联系人: 袁媛客户服务热线: 0755-83199511 网站: www.csc.com.cn (15) 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: 北京市朝阳区朝阳门内大街 188 号法定代表人: 王常青电话: 010-65183880 传真: 010-65182261 联系人: 刘芸客户服务热线: 400-8888-108 网站: www.csc108.com (16) 申万宏源证券有限公司注册地址: 上海市常熟路 171 号办公地址: 上海市长乐路 989 号 40F 法定代表人: 储晓明电话: 021-54041654 传真: 021-33388217 联系人: 王叔胤客户服务热线: 95523 或 400-889-5523 网站: www.sywg.com.cn (17) 国泰君安证券股份有限公司注册地址: 上海市浦东新区商城路 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: 万建华电话: 021-38676666 传真: 021-38670666 联系人: 朱雅崑客户服务热线: 400-8888-666 网站: www.gtja.com (18) 新时代证券有限责任公司注册地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 办公地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 法定代表人: 刘汝军电话: 010-83561146 传真: 010-83561094 联系人: 田芳芳客户服务热线: 400-698-9898 网站: www.xsdzq.cn (19) 长江证券股份有限公司注册地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦办公地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦法定代表人: 胡运钊电话: 027-65799999 传真: 027-85481900 联系人: 付研/陈杨客户服务热线: 400-888-8999 网站: www.95579.com (20) 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 网站: www.dtsbc.com.cn (21) 广州证券有限责任公司注册地址: 广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 5 楼法定代表人: 吴志明电话: (8620)88836999-5408 传真: (8620)88836920 联系人: 梁微客户服务热线: 020-961303 网站: www.gzs.com.cn (22) 信达证券股份有限公司注册地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼办公地址: 北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层 (信达证券) 法定代表人: 高冠江电话: 010-83252183 联系人: 尹旭航客户服务热线: 400-800-8899 网站: www.cindasc.com (23) 华安证券有限责任公司注册地址: 安徽省合肥市长江中路 357 号办公地址: 安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座 24 层-32 层法定代表人: 李工电话: 0551-5161666 传真: 0551-5161600 联系人: 汪燕客户服务热线: 96518、400-809-6518 网站: www.hazq.com (24) 国联证券股份有限公司注册地址: 江苏省无锡市县前东街 168 号办公地址: 江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6-8 楼法定代表人: 雷建辉电话: 0510-82831662 传真: 0510-82830162 联系人: 沈刚客户服务热线: 95570 网站:

www.glsc.com.cn (25) 国金证券股份有限公司注册地址: 成都市东城根上街 95 号办公地址: 成都市东城根上街 95 号法定代表人: 冉云电话: 028-86690126 传真: 028-86690126 联系人: 刘婧漪客户服务热线: 95310 网站: www.gjq.com.cn (26) 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、19 号楼办公地址: 上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦法定代表人: 赵俊电话: 0519-88157761 传真: 0519-88157761 联系人: 王一彦客户服务热线: 95531、400-888-8588 网站: www.longone.com.cn (27) 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 16-26 层办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层法定代表人: 何如电话: 0755-82130833 传真: 0755-82133952 联系人: 李颖客户服务热线: 95536 网站: www.guosen.com.cn (28) 华宝证券有限责任公司注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层法定代表人: 陈林电话: 021-68777222 传真: 021-68777723 联系人: 刘闻川/李曼客户服务热线: 400-820-9898 网站: www.cnhbstock.com (29) 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: 周易电话: 025-83290537 传真: 025-51863323 联系人: 庞晓芸客户服务热线: 400-8888-168、95597 网站: www.htsc.com.cn (30) 西藏东方财富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: 贾绍君电话: 021-36533016 传真: 021-36533017 联系人: 周艳琼客户服务热线: 400-881-1177 网站: www.xzsec.com (31) 爱建证券有限责任公司注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼法定代表人: 钱华电话: 021-32229888 传真: 021-62878783 联系人: 袁峻客户服务热线: 021-63340678 网站: www.ajzq.com (32) 中信证券股份有限公司注册地址: 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 20 层法定代表人: 王东明电话: 010-60838888 传真: 010-60833739 联系人: 秦夏客户服务热线: 95558 网站: www.cs.ecitic.com (33) 东莞证券股份有限公司住所: 广东省东莞市莞城区可园南路一号办公地址: 广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼法定代表人: 张运勇电话: 0769-22116557 传真: 0769-22119423 联系人: 萧浩然客服电话: 0769-961130 网站: www.dgzq.com.cn (34) 中信证券(山东)有限责任公司注册地址: 青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层(1507-1510 室)办公地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层法定代表人: 杨宝林电话: 0532-85022326 传真: 0532-85022605 联系人: 孙秋月客户服务热线: 0532-95548 网站: www.zxwt.com.cn (35) 中邮证券有限责任公司注册地址: 西安市碑林区太白北路 320 号办公地址: 西安市高新区唐延路 5 号陕西邮政大厦 9-11 层法定代表人: 李春太电话: 029-88602147 传真: 029-88602138 联系人: 吉亚利客户服务热线: 4008-888-005 网站: www.cnpsec.com.cn (36) 华龙证券有限责任公司注册地址: 甘肃省兰州市静宁路 308 号办公地址: 甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富中心财富大厦法定代表人: 李晓安电话: 0931-8784656 传真: 0931-4890118 联系人: 范坤客户服务热线: 400-689-8888 网站: www.hlzqgs.com (37) 华融证券股份有限公司注册地址: 北京市西城区金融大街 8 号办公地址: 北京市西城区金融大街 8 号法定代表人: 宋德清电话: 010-58568235 传真: 010-58568062 联系人: 李慧灵客户服务热线: 010-58568118 网站: www.hrsec.com.cn (38) 国海证券股份有限公司注册地址: 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: 牛孟宇客户服务热线: 95563 网站: www.ghzq.com.cn (39) 联讯证券有限责任公司注册地址: 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 网站: www.lxq.com.cn (40) 东北证券股份有限公司注册地址: 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 网站: www.nesc.cn (41) 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: 福州市湖东路 268 号证券大厦 16F 法定代表人: 兰荣电话: 0591-38162212/0591-38507715 传真: 0591-38507538 联系人: 夏中苏/黄英客户服务热线: 95562 网站:

www.xyqz.com.cn (42) 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 网站: WWW.CICC.COM.CN (43) 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: 刘熠客服电话: 95353 网站: www.tebon.com.cn (44) 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: 陆晓客服电话: 400-860-1555 网站: www.dwjq.com.cn (45) 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: 洪诚客服电话: 400-9908-826 网站: www.citicsf.com (46) 华西证券股份有限公司注册地址: 四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦办公地址: 四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦法定代表人: 杨炯洋电话: 010-52723297 联系人: 朱蕴涛客服电话: 95584 网站: www.hx168.com.cn (47) 天相投资顾问有限公司注册地址: 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701办公地址: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层法定代表人: 林义相联系人: 赵彩玲联系方式: jjcp@txsec.com 客户服务热线: 010-66045678 网站: www.txsec.com (48) 上海天天基金销售有限公司注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼办公地址: 上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼法人代表: 其实电话: 021-54509988 联系人: 丁珊珊客户服务热线: 400-181-8188 网站: www.1234567.com.cn (49) 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楼法人代表: 杨文斌电话: 13916988520 联系人: 陆敏客户服务热线: 400-700-9665 网站: www.ehowbuy.com (50) 浙江同花顺基金销售有限公司注册地址: 浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼办公地址: 浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼法人代表: 凌顺平电话: 13675861499 联系人: 吴杰客户服务热线: 4008-773-772 网站: www.5ifund.com (51) 和讯信息科技有限公司注册地址: 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层办公地址: 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层法人代表: 王莉电话: 13911828608 联系人: 刘洋客户服务热线: 400-920-0022 网站: www.licaike.com (52) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司注册地址: 上海市虹口区飞虹路360弄9号37244办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801法人代表: 汪静波电话: 15801816961 联系人: 张裕客户服务热线: 400-821-5399 网站: www.noah-fund.com (53) 深圳众禄基金销售有限公司注册地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元办公地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元法人代表: 薛峰电话: 0755-33227950 联系人: 童彩平客户服务热线: 400-6788-887 网站: www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com (54) 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办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203法人代表: 肖雯电话: 13430246009 联系人: 黄敏嫦客户服务热线: 020-89629066 网站: www.yingmi.cn (55) 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单元办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼法人代表: 郭坚电话: 15921301165 联系人: 程晨客户服务热线: 4008-6666-18 网站: www.lufunds.com (56) 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室办公地址: 北京市朝阳区东三环北路27号嘉铭中心B座10层法人代表: 梁越电话: 18641514414 联系人: 张鼎客户服务热线: 4008-980-618 网站: www.chtfund.com (57) 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层法人代表: 张跃伟电话: 18670341071 联系人: 周雨平客户服务热线: 400-820-2899 网站: www.erichfund.com (58) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司注册地址: 北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层法人代表: 彭运年电话: 010-59336519 联系人: 孙雯客户服务热线: 010-59336512 网站: www.jnlc.com (59) 嘉实财富管理有限公司注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元办

公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层法人代表：赵学军电话：13811039451 联系人：余永健客户服务热线：400-021-8850 网站：www.harvestwm.cn (60) 深圳富济财富管理有限公司注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室办公地址：深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室法人代表：齐小贺电话：0755-83999907-806 联系人：黄晶龙客户服务热线：0755-83999907 网站：www.jinqianwo.cn (61) 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：北京朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融大厦 38 层法人代表：张冠宇电话：13121820670 联系人：刘美薇客户服务热线：400-819-9868 网站：www.tdyhfund.com (62) 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 楼办公地址：上海市徐汇区虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼法人代表：冯修敏电话：021-54677088-6732 联系人：陈云卉客户服务热线：400-821-3999 网站：www.chinapnr.com (63) 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#办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层法人代表：杨懿电话：18502354557 联系人：文雯客户服务热线：400-166-1188 网站：8.jrj.com.cn (64) 浙江金观诚财富管理有限公司注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室办公地址：浙江省杭州市登云路 43 号金诚集团 10 楼法人代表：徐黎云电话：0571-88337717 联系人：孙成岩网站：www.jincheng-fund.com (65) 北京创金启富投资管理有限公司注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A 办公地址：中国北京西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 座综合楼 712 号法定代表人：梁蓉联系人：郭爱丽电话：15101582096 客服：400-6262-818 网址：www.5irich.com (66) 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 室办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层法人代表：燕斌电话：021-52822063 联系人：陈东客户服务热线：021-52822063 网站：www.66zichan.com (67) 奕丰金融服务（深圳）有限公司注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1116 室及 1307 室法定代表人：TANYIKKUAN 联系人：叶健电话：13424264100 客服：400-684-0500 网址：www.ifastps.com.cn (68) 北京汇成基金销售有限公司注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号法定代表人：王伟刚联系人：丁向坤电话：18001102931 网址：www.fundzone.cn 客服：400-619-9059 (69) 众升财富(北京)基金销售有限公司注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08 法定代表人：李招弟联系人：李艳电话：13611256407 客服：400-059-8888 网址：www.wy-fund.com (70) 上海利得基金销售有限公司注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 10 楼办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼法人代表：沈继伟电话：18601735759 联系人：徐鹏客户服务热线：400-067-6266 网站：www.leadbank.com.cn (71) 北京晟视天下投资管理有限公司注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 28 层法定代表人：蒋煜联系人：殷雯电话：18310599275 客服：400-818-8866 网址：www.shengshiview.com (72) 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：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F 法定代表人：陈柏青电话：0571-26888888 联系人：韩爱彬联系人邮箱：aibin.hab@alipay.com 客户服务热线：400-0766-123 网站：www.fund123.cn (73) 泰信财富投资管理有限公司注册地址：北京市石景山区实兴大街 30 号院 3 号楼 8 层 8995 房间办公地址：北京市石景山区实兴大街 30 号院 3 号楼 8 层 8995 房间法定代表人：李静联系人：刘春霞电话：13522530189 客户服务热线：400-881-5596 网址：www.taixincf.com (74) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809 办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 soho 现代城 C 座 18 层 1809 法定代表人：戎兵联系人：张得仙电话：13520443582 客服：400-6099-200 网址：www.yixinfund.com (75) 上海基煜基金销售有限公司注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503-1504 室法定代表人：王翔联系人：吴鸿飞电话：17721005485 客服：400-820-5369 网址：www.jiyufund.com.cn (76) 乾道金融信息服务（北京）有限公司注册地址：北京市海

淀区东北旺村南1号楼7层7117室办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室法定代表人：王兴吉联系人：刘金佩电话：15901073209 客服：400-088-8080 网址：www.qiandaojr.com（77）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765号602-115室办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4F法定代表人：陈继武联系人：王哲宇电话：021-63333319 客服：4006-433-38953（78）杭州科地瑞富基金销售有限公司注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心1604室办公地址：杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼法定代表人：陈刚联系人：毛肖勇电话：18888952115 客服：0571-86655920 网址：www.cd121.com（79）深圳盈信基金销售有限公司注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1办公地址：大连市中山区南山路155号南山1910-A3-1法定代表人：苗宏升联系人：王清臣电话：13522300698 客服：4007-903-688 网址：www.fundying.com（80）上海朝阳永续基金销售有限公司注册地址：上海市浦东新区张江碧波路690号4号楼2楼办公地址：上海市浦东新区张江碧波路690号4号楼2楼法定代表人：廖冰联系人：陆纪青电话：15902135304 客服：400-998-7172 网址：www.998fund.com（81）南京苏宁基金销售有限公司注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5法定代表人：钱燕飞联系人：王锋电话：025-66996699-887226 客服：95177 网址：www.snjjin.com（82）北京钱景基金销售有限公司注册地址：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法人代表：赵荣春电话：18501250851 联系人：陈剑炜客户服务热线：400-893-6885 网站：www.dyxtw.com（83）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心龙园3号办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中心龙园3号法人代表：林卓联系人：姜奕竹客户服务热线：400-6411-999 网站：www.taichengziben.com（84）大泰金石基金销售有限公司注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室办公地址：南京市建邺区江东中路222号奥体中心文体创业园法人代表：袁顾明电话：15921264785 联系人：赵明网站：www.dtfunds.com（85）北京蛋卷基金销售有限公司注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院望京SOHO塔319层法人代表：钟斐斐电话：15910450297 联系人：侯芳芳客户服务热线：4000-618-518 网站：www.ncfj.com（86）北京肯特瑞财富投资管理有限公司注册地址：北京市北京经济技术开发区科创十一街18号C座2层221室办公地址：北京市北京经济技术开发区科创十一街18号C座2层222室法定代表人：刘强东联系人：徐伯宇电话：15011323441 客服：400-088-8816 网址：jr.jd.com（87）深圳市金斧子基金销售有限公司注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼办公地址：深圳市南山区科苑路科兴科学园B3栋7F法定代表人：赖任军联系人：张焯电话：0755-66892301 客服：400-9302-888 网址：www.jfzinv.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新增为本基金的代销机构，并及时公告。

4、同利的场内销售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站（<http://www.szse.cn/>）。

（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：天津嘉德恒时律师事务所住所：天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座1009-1010办公地址：天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座1009-1010法定代表人：孟卫民电话：（022）83865255 传真：（022）83865266 经办律师：韩刚、续宏帆联系人：续宏帆（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）23238800 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同利A、同利B两级份额，所募集的基金资产合并运作。

1、基金份额配比

本基金同利A、同利B的份额配比原则上不超过7:3。

本基金募集设立时，同利A、同利B的份额配比将不超过7:3。

本基金在分级基金运作期内，同利A自《基金合同》生效之日起每满一年开放一次，同利B封闭运作并上市交易。在同利A的每次开放日，基金管理人将对同利A进行基金份额折算，同利A的基金份额净值调整为1.000元，基金份额持有人持有的同利A份额数按折算比例相应增减。为此，在同利A的单个开放日，如果同利A没有赎回或者净赎回份额极小，同利A、同利B在该次开放日后的份额配比可能会出现大于7:3的情形；如果同利A的净赎回份额较多，同利A、同利B在该次开放日后的份额配比可能会出现小于7:3的情形。

2、同利A的运作

(1) 收益率

同利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：
同利A的年收益率（单利）=1.61年期银行定期存款利率

同利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。

在基金成立日当日，基金管理人将根据《基金合同》生效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设定同利A的首次收益率；在本基金成立后每满一年的最后一个工作日，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同利A的收益率。

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%，则同利A的年收益率（单利）为：

同利A的年收益率（单利）=1.63%=4.8%

(2) 开放日

同利A在《基金合同》生效后每满一年开放一次，接受投资者的申购与赎回。

同利A的开放日为自《基金合同》生效之日起每满一年的最后一个工作日。

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。

同利A的第一次开放日为《基金合同》生效后满一年的日期，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》生效后满两年的日期，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，如果本基金基金合同于2013年3月15日生效，基金合同生效之日起满一年、满两年的日期分别为2014年3月14日、2015年3月14日，以此类推。其中，假设2015年3月14日为非工作日，在其之前的最后一个工作日为2015年3月13日，则第二次开放日为2015年3月13日。

(3) 基金份额折算

本基金成立后每满一年的最后一个工作日，对同利A进行基金份额折算，同利A的基金份额净值调整为1元，同利A的份额数按折算比例相应增减。

同利A的基金份额折算基准日与开放日为同个工作日。

同利A的基金份额折算具体见本招募说明书第九部分以及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，同利A的份额余额原则上不得超过7/3倍同利B的份额余额。具体规模限制及其控制措施见《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、同利B的运作

(1) 同利B封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回。

同利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，同利 B 将申请在深圳证券交易所上市交易。本基金的同利 B 份额已于 2013 年 10 月 30 日在深圳证券交易所上市交易。

(3) 本基金在扣除同利 A 的本金及应计收益后的全部剩余资产归同利 B 享有，亏损以同利 B 的资产净值为限由同利 B 承担。

4、基金份额发售

同利 A、同利 B 将分别通过各自发售机构的销售网点独立进行公开发售。

5、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同利 A 和同利 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 3 位，小数点后第 4 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。

6、同利 A 和同利 B 的基金份额净值计算

本基金《基金合同》生效后，在同利 A 的开放日计算同利 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同利 A 和同利 B 的基金份额净值。

(1) 同利 A 的基金份额净值计算

本基金《基金合同》生效后，截止同利 A 的某一开放日或者基金转换时的份额转换基准日（ T 日），设为自同利 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，为 T 日闭市后的基金资产净值，为 T 日同利 A 的份额余额，为 T 日同利 B 的份额余额，为 T 日同利 A 的基金份额净值，为在同利 A 上一次开放日（如 T 日为第一次开放日，则为基金成立日）设定的同利 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 日同利 A 的份额余额加上 T 日全部同利 A 份额应计收益之和，则：

T 日全部同利 A 份额应计收益计算公式如下：

T 日全部同利 A 份额应计收益 = (下同)

以上各式中，运作当年实际天数指同利 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。

2) 如果 T 日闭市后的基金资产净值小于 1.00 元乘以 T 日同利 A 的份额余额加上 T 日全部同利 A 份额应计收益之和，则：

(2) 同利 B 的基金份额净值计算

设为基金转型时的份额转换基准日（ T 日）同利 B 的基金份额净值，同利 B 的基金份额净值计算公式如下：

同利 A、同利 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，设自同利 A 上一次开放日起的运作天数和基金运作当年的实际天数均为 365 天，基金资产净值为 35 亿元，同利 A、同利 B 的份额余额分别为 21 亿份和 9 亿份，同利 A 上一次开放日设定的同利 A 年收益率为 4.80%。则同利 A、同利 B 的基金份额净值计算如下：

同利 A 的基金份额净值 = 1.048 (元)

同利 B 的基金份额净值 = 1.44355556 (元)

7、同利 A 和同利 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

告同利 A 和同利 B 的基金份额参考净值，其中，同利 A 的基金份额参考净值计算日不包括同利 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）同利 A 的基金份额参考净值计算

本基金《基金合同》生效后 3 年期内，在同利 A 的非开放日（T 日），设为自同利 A 上一次开放日（如 T 日之前同利 A 尚未进行开放，则为基金成立日）至 T 日的运作天数，为 T 日闭市后的基金资产净值，为 T 日同利 A 的份额余额，为 T 日同利 B 的份额余额，为 T 日同利 A 的基金份额参考净值，为在同利 A 上一次开放日（如 T 日之前同利 A 尚未进行开放，则为基金成立日）设定的同利 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 日同利 A 的份额余额加上 T 日全部同利 A 份额应计收益之和，则：

T 日全部同利 A 份额应计收益计算公式如下：

T 日全部同利 A 份额应计收益 = (下同)

以上各式中，运作当年实际天数指同利 A 上一次开放日（如 T 日之前同利 A 尚未进行开放，则为基金成立日）所在年度的实际天数，下同。

2) 如果 T 日闭市后的基金资产净值小于 1.00 元乘以 T 日同利 A 的份额余额加上 T 日全部同利 A 份额应计收益之和，则：

（2）同利 B 的基金份额参考净值计算

为 T 日同利 B 的基金份额参考净值，同利 B 的基金份额参考净值计算公式如下：

上式中，在同利 A 的非开放日，为同利 A 的基金份额参考净值；在同利 A 的开放日，为同利 A 的基金份额净值。

同利 A、同利 B 的基金份额参考净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的同利 A 和同利 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，设自同利 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 31 亿元，同利 A、同利 B 的份额余额分别为 21 亿份和 9 亿份，同利 A 上一次开放日设定的同利 A 年收益率为 4.8%。则同利 A、同利 B 的基金份额参考净值计算如下：

同利 A 的基金份额参考净值 = 1.007 (元)

同利 B 的基金份额参考净值 = 1.095 (元)

（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，同利 A、同利 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。本基金已于 2016 年 9 月 19 日三年期届满，同利 A、同利 B 已转换成上市开放式基金（LOF）份额，转换结果详见本基金管理人于 2016 年 9 月 21 日发布的《天弘同利分级债券型证券投资基金基金份额转换结果公告》。

五、基金的名称

本基金名称：天弘同利分级债券型证券投资基金自 2016 年 9 月 20 日起，本基金名称变更为：天弘同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、同利 A 的基金份额折算

本基金在分级基金运作期内，同利 A 将按以下规则进行基金份额折算，本基金的分级基金运作期已于 2016 年 9 月 19 日结束。

（一）折算基准日

本基金在分级基金运作期内，同利 A 的基金份额折算基准日为自《基金合同》生效之日起每满一年的最后

一个工作日。

同利 A 的基金份额折算基准日与其开放日为同一个工作日。基金份额折算基准日的具体计算见本招募说明书第六部分中同利 A 的运作的相关内容。

（二）折算对象

基金份额折算基准日登记在册的同利 A 所有份额。

（三）折算频率

自《基金合同》生效之日起每满一年折算一次。

（四）折算方式

折算日日终，同利 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，折算后，基金份额持有人持有的同利 A 的份额数按照折算比例相应增减。

同利 A 的基金份额折算公式如下：

同利 A 的折算比例 = 折算日折算前同利 A 的基金份额净值 / 1.000

同利 A 经折算后的份额数 = 折算前同利 A 的份额数 × 同利 A 的折算比例

同利 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，折算日折算前同利 A 的基金份额净值、同利 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本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规定暂停同利 B 的上市交易等业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（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 日在至少一家指定媒体和基金管理人互联网网站（以下简称网站）公告，并报中国证监会备案。

2、基金份额折算结束后，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。

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，在同利 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，同利 B 的基金份额将申请在深圳证券交易所上市交易。同利 B 上市后，登记在证券登记结算系统中的同利 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同利 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

同利 B 基金份额已于 2013 年 10 月 30 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。

同利 B 基金份额于 2013 年 10 月 30 日在深圳证券交易所上市交易并于 2016 年 9 月 19 日终止上市。本基金完成基金转型后，天弘同利债券型证券投资基金（LOF）于 2016 年 9 月 30 日在深交所上市交易。

（四）上市交易的规则

- 1、同利 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，指同利 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，指同利 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，为同利 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，指同利 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同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，同利 A、同利 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）基金转型时同利 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 年期届满日与同利 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同利 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同利 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 1.000 元。

在份额转换基准日日终，以份额转换后 1.000 元的基金份额净值为基准，同利 A、同利 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：

同利 A 份额（或同利 B 份额）的转换比率 = 份额转换基准日同利 A（或同利 B）的基金份额净值 / 1.000

同利 A（或同利 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同利 A（或同利 B）的份额数 × 同利 A 份额（或同利 B 份额）的转换比率

在进行份额转换时，同利 A、同利 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；同利 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，同利 A 份额（或同利 B 份额）的转换比率、同利 A（或同利 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

同利 A、同利 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）同利 A、同利 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

本基金在有效控制风险的基础上，力求获得稳健的投资收益。

十一、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）、中小企业私募债券、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中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具及其衍生工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购或增发新股投资，但可持有因可转债转股所形成的股票（包括因持有该股票所派发的权证）以及因投资可分离债券而产生的权证。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 30 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。基金的投资组合比例为：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%，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，力求获得稳健的投资收益。

1、资产配置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，动态调整固定收益类证券组合久期和类属结构，对各类债券金融工具及现金进行优化配置。2、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。3、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。

4、债券类属选择本基金根据对金融债、企业债（公司债）、可转债等债券品种与同期限国债之间利差（可转债为期权调整利差（OAS））变化分析与预测，确定不同类属债券的投资比例及其调整策略。5、个债选择本基金根据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债券品种进行投资。对于含权类债券品种，如可转债等，本基金还将结合公司基本面分析，综合运用衍生工具定价模型分析债券的内在价值。6、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。7、中小企业私募债券投资策略中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资者数量上限，整体流动性相对较差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。本基金将采取谨慎投资策略进行中小企业私募债券的投资，在重点分析和跟踪发债主体的信用基本面基础上，综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定具体个券的投资策略。

（二）投资决策流程

1、决策依据

- （1）国家有关法律、法规和《基金合同》的规定；
- （2）以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则；
- （3）国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及全球经济因素分析。

2、投资管理程序

（1）备选库的形成与维护

对于债券投资，分析师通过宏观经济、货币政策和债券市场的分析判断，采用利率模型、信用风险模型及期权调整利差（OAS）对普通债券和含权债券进行分析，在此基础上形成基金债券投资的备选库。

（2）资产配置会议

本基金管理人定期召开资产配置会议，讨论基金的资产组合以及个股配置，形成资产配置建议。

（3）构建投资组合

投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下，审议并确定基金资产配置方案，并审批重大单项投资决定。

基金经理在投资决策委员会的授权下，根据本基金的资产配置要求，参考资产配置会议、投研会议讨论结果，制定基金的投资策略，在其权限范围进行基金的日常投资组合管理工作。

（4）交易执行

基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

（5）投资组合监控与调整

基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况，风险管理部与监察稽核部对基金投资进行日常监督，风险分析师负责完成内部的基金业绩和风险评估。基金经理定期对证券市场变化和基金投资阶段成果和经验进行总结评估，对基金投资组合不断进行调整和优化。

十三、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：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履行相关程序后，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，同利 A 为低风险、收益相对稳定的基金份额；同利 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。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 11 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 2017 年 06 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计，以下内容摘自本基金 2017 年第 2 季度报告：

1、期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

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 基金投资 -- --

3 固定收益投资 629,583,202.40 96.88

其中：债券 629,583,202.40 96.88

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 3,836,235.93 0.59

8 其他资产 16,469,165.89 2.53

9 合计 649,888,604.22 100.00

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、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 国家债券 -- --

2 央行票据 -- --

3 金融债券 109,360,000.00 18.73

其中：政策性金融债 109,360,000.00 18.73

4 企业债券 479,868,329.60 82.20

5 企业短期融资券 -- --

6 中期票据 40,058,000.00 6.86

7 可转债(可交换债) 296,872.80 0.05

8 同业存单 -- --

9 其他 -- --

10 合计 629,583,202.40 107.84

5、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（张） 公允价值(元) 占基金资产净值比例（%）

1 170210 17 国开 10 500,000 49,375,000.00 8.46

2 122513 12 伟星集 395,000 39,808,100.00 6.82

3 122735 11 六安债 377,000 39,170,300.00 6.71

4 124915 14 宏桥 02 362,000 36,648,880.00 6.28

5 112227 14 利源债 313,200 32,052,888.00 5.49

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、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、本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在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之备选股票库的情况。

11.3、期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 12,175.44

2 应收证券清算款 —

3 应收股利 —

4 应收利息 14,155,283.35

5 应收申购款 2,301,707.10

6 其他应收款 —

7 待摊费用 —

8 其他 —

9 合计 16,469,165.89

11.4、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 1110031 航信转债 296,872.80 0.05

11.5、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 2013 年 9 月 17 日，基金业绩数据截至 2017 年 06 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（转型前）

阶段(天弘同利分级债券) 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2013/09/17-2013/12/31 0.10% 0.08% -2.55% 0.09% 2.65% -0.01%

2014/01/01-2014/12/31 14.21% 0.25% 6.54% 0.11% 7.67% 0.14%

2015/01/01-2015/12/31 24.60% 0.53% 4.19% 0.08% 20.41% 0.45%

2016/01/01-2016/09/19 8.09% 0.23% 0.58% 0.06% 7.51% 0.17%

自基金合同生效日起至转型日（2013 年 09 月 17 日-2016 年 09 月 19 日） 53.96% 0.36% 8.81% 0.09% 45.15% 0.27%

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（转型后）

阶段

(天弘同利债券（LOF）

份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2016/09/20-2016/12/31 -0.60% 0.11% -2.20% 0.14% 1.60% -0.03%

2017/01/01-2017/06/30 0.30% 0.09% -2.11% 0.08% 2.41% 0.01%

自基金合同转型日起至至今（2016 年 09 月 20 日-2017 年 06 月 30 日） -0.30% 0.10% -4.27% 0.10% 3.97% 0.00%

注：本基金合同于 2013 年 9 月 17 日生效，于 2016 年 9 月 19 日 3 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： $H = E \times 0.70\%$ 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每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 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、公休假等，支付日期顺延。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： $H = E \times 0.20\%$ 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每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。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。本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。销售服务费费的计算方法如下： $H = E \times 0.35\%$ 当年天数 H 为每日应计提的销售服务费 E 为前一日的基金资产净值销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。上述（一）基金费用的种类中第 4—8 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

下列费用不列入基金费用：1、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；2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；3、《基金合同》生效前的相关费用；4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》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2017年4月28日公告的《天弘同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、更新了三、基金管理人中相关内容。3、更新了四、基金托管人中相关内容。4、更新了五、相关服务机构中相关内容。5、更新了十、基金份额的申购与赎回中相关内容；6、更新了十五、基金投资组合报告相关内容，该部分内容均按有关规定编制。7、更新了十六、基金的业绩的相关内容，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。8、更新了二十八、其他应披露的事项，披露了自上次内容更新截止日至本次内容更新截止日期间涉及本基金及基金管理人的相关公告。

天弘基金管理有限公司

二〇一七年十月二十七日