鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）上市交易公告书

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2016年5月24日
公告日期：2016年5月19日

一、重要声明与提示

鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，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、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请仔细阅读2015年12月3日刊登在《中国证券报》和本公司指定销售机构网站上的《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金更新的招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）
2、基金类型：债券型
3、基金运作方式：契约型开放式
4、本基金的存续期限为不定期。
5、基金份额总额：截至2016年5月17日，本基金的基金份额总额为1,030,652,788.10份
6、基金份额净值：截至2016年5月17日，鹏华丰利的基金份额净值为1.005元
7、本次上市交易的基金份额简称及其基金代码：基金简称：鹏华丰利，基金代码：160622
8、本次上市交易的基金份额总额：27,657,952.00份
9、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
10、上市交易日期：2016年5月24日
11、基金管理人：鹏华基金管理有限公司
12、基金托管人：招商银行股份有限公司
13、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的历史、转型及折算后结果、上市交易和跨系统转托管

（一）本基金的历史

鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）由鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金分级运作届满转型而成。

鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金经中国证监会许可【2013】154号核准募集。

鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。基金管理人于2013年4月23日获得中国证监会书面确认，《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金合同》生效，基金募集规模2,999,634,101.44份。

（二）本基金的转型

根据《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金《基金合同》生效后分级运作3年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，即转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）”。基金管理人于2016年4月19日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站及本基金管理人网站上披露了《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金分级运作期届满转型后基金名称变更及转换基准日等事项的公告》和《关于鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金之丰利债A开放赎回业务的公告》。

本基金管理人于2016年4月25日对鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金进行了3年期分级运作届满到期后的基金转型工作。经本基金基金管理人计算并经本基金基金托管人招商银行股份有限公司确认，基金份额转换基准日（2016年4月25日）转型前鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金之丰利A份额（以下简称丰利A）的基金份额净值为1.000，本基金管理人按照1：1.00023770的转换比例进行了折算，折算后基金份额净值为1.000元，折算后的原丰利A的基金份额总额由31,436,555.08份调整为31,444,027.55份；转型前鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金之丰利B份额（以下简称丰利B）的基金份额净值为1.163元，本基金管理人按照1：1.16266658的转换比例进行了折算，折算后基金份额净值为1.000元，折算后的原丰利B的基金份额由899,854,638.73份调整为1,046,230,914.43份；基金份额总额与持有人持有的基金份额数额将发生调整，份额折算对持有人的权益无实质性影响。 本基金管理人已向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请并于2016年4月27日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、基金管理人网站及深圳证券交易所网站发布了《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金分级运作期届满基金份额转换结果公告》。

（三） 本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2016]315号
2、上市交易日期：2016年5月24日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
4、基金简称：鹏华丰利债券（LOF） 场内简称：鹏华丰利
5、交易代码：160622
6、本次上市交易份额：27,657,952.00份（截至2016年5月17日）
7、基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）的基金份额净值，并在深圳证券交易所行情发布系统揭示。
8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。
（四）本基金转托管的主要内容：为了保证基金份额持有人的利益，本基金管理人向深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司提出申请，为基金份额持有人开通了转托管业务的办理事宜。

四、持有人户数、持有人结构及场内前十名持有人

（一）基金份额持有情况

截至2016年5月17日，鹏华丰利基金的持有人总户数1,016户，其中场外持有人总户数915户，场内持有人总户数101户。

平均每户持有的场内基金份额：273.841.11份

场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：机构持有23,823,769.00份，占86.1371% 场内个人投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：个人持有3,834,183.00份，占13.8629%

（二）截至2016年5月17日，场内鹏华丰利基金份额前十名持有人情况：

序号	持有人名称	持有鹏华丰利份额	占鹏华丰利份额比(%)
1	鹏华基金管理有限公司	11,627,682.00	42.04%
2	瑞泰人寿保险有限公司－万能	3,540,901.00	12.80%
3	融通资本财富－农业银行－融通资本共赢量化2号资产管理计划	2,341,502.00	8.47%
4	光大证券－光大银行－光大阳光5号集合资产管理计划	1,651,447.00	5.97%
5	庄瀚	1,233,240.00	4.46%
6	融通资本财富－宁波银行－融通资本融通定3号专项资产管理计划	1,190,746.00	4.31%
7	冯月碧	565,754.00	2.05%
8	绍兴市新宇资产管理有限公司－新宇资产管理1号私募投资基金	508,410.00	1.84%
9	中国太平洋人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品	474,157.00	1.71%
10	中国证券业协会企业年金计划－招商银行股份有限公司	472,415.00	1.71%
		23,606,254.00	85.35%

（三）截至2016年5月17日，基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为0.00份，占该基金总份额的比例为0%。其中，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为0.00份，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为0.00份。

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：鹏华基金管理有限公司
2、法定代表人：何如
3、总经理：邓召明
4、注册资本：1.5亿元人民币
5、注册地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]31号
7、工商登记注册的法人营业执照文号：4403011013037
8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
9、存续期间：持续经营
10、股东及其出资比例：公司股东由国信证券有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，三家股东的出资比例分别为50%、49%、1%。
11、内部组织结构及职能：
权益投资一部
负责公司公募基金产品、社保、企业年金和专户理财投资业务。
权益投资二部
负责公司公募基金产品和专户理财投资业务。
绝对收益投资部
以新股业务为核心，包括现有以及即将发行和改造的新股产品，同时兼顾以绝对回报为目标的非保险、社保专户业务。
量化及衍生品投资部
负责公司公募、专户理财及其他委托投资业务的数量化及衍生品的研究和投资等相关业务。
固定收益部
负责公司固定收益证券的研究、投资工作。
研究部
责任业及上市公司研究，在公司既定的投资理念和研究理念的基础上，以系统性的研究方法和高质量的研究成果为公司投资部门提供持续有效的支持工作。
集中交易室
负责执行公司既定的各基金的投资指令并及时反馈市场信息。
国际业务部
负责QDII基金海外投资研究和QFII业务开拓，进行相关国际业务产品研究分析。
投资银行部
负责公司新三板和股权投资基金等相关业务工作。
产品规划部
负责制定公司产品规划与发展策略以及产品设计、产品管理和产品研究工作，完善公司产品线，丰富公司产品储备。
监察稽核部
负责公司各项制度、业务的合法合规性审核，对公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，以及采用定量分析的手段，对公司管理的各种资产组合的投资收益进行风险和绩效评估。
总裁办公室
负责公司财务管理、日常行政事务管理。
人力资源部
负责公司人力资源管理工作。
登记结算部
负责安全高效地完成资产组合的估值，注册登记及资金清算业务，保障后台运作正常运行。
信息技术部
负责公司信息技术系统开发、运行和维护，为公司战略和业务发展提供全面、及时、可靠的信息技术支持。
市场发展部
负责贯彻公司管理层的战略规划，组织基金销售工作，进行渠道管理以及客户服务工作。
营销策划部
负责公司品牌管理、媒体和广告管理、营销策划与销售支持等各项职能工作。
机构理财部
负责开展公募基金直销、专户理财、社保、企业年金等各项业务的营销和服务工作。
电子商务部
负责公司电子商务平台的搭建、业务推广和公司网站的建设、更新、内容维护，以及第三方销售机构的渠道管理工作。
渠道业务部
负责公司券商渠道销售管理及服务工作。
北京分公司
主要负责北方地区的基金销售业务。
上海分公司
主要负责华东区域的基金销售业务。
武汉分公司
主要负责华中区域的基金销售业务。
广州分公司
主要负责华南区域的基金销售业务。
鹏华资产管理（深圳）有限公司
负责特定客户资产管理业务及中国证监会许可的其他业务。
12、人员情况
截至2016年3月31日，公司共有员工301人，其中，博士占比3.7%，硕士占比60.5%，本科占比32.6%，其他占比3.2%。
13、信息披露负责人及咨询电话
张戈 0755－82825720
14、本基金基金经理

刘太阳先生，国籍中国，理学硕士，10年金融证券从业经验。曾任中国农业银行金融市场部高级交易员，从事债券投资交易工作；2011年5月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究工作，担任固定收益部研究员，2012年9月起担任鹏华纯债债券基金基金经理，2012年12月至2014年3月担任鹏华理财21天债券基金（2014年3月已转型为鹏华月月发短期理财债券基金）基金经理，2013年4月起兼任鹏华丰利分级债券基金基金经理，2013年5月起兼任鹏华实业债纯债债券基金基金经理，2014年3月至2015年4月兼任鹏华月月发短期理财债券基金基金经理，2015年3月起兼任鹏华丰盛债券基金基金经理，2016年2月起兼任鹏华弘盛混合基金基金经理，现同时担任固定收益部副总经理。刘太阳先生具备基金从业资格。

（二）基金托管人

1、基本情况
名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）
设立日期：1987年4月8日
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本：252.20亿元
法定代表人：李建红
行长：田惠宇
资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号
电话：0755－83199084
传真：0755－83195201
资产托管部信息披露负责人：张燕
2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截止,2015年6月30日，本集团总资产5.2212万亿元人民币，高级法下资本充足率12.40%，权重法下资本充足率11.77%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工60人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品；在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过十三年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2015年招商银行加大高收益托管产品营销力度，截止9月末新增托管公募开放式基金38只，新增首发公募开放式基金托管规模755.66亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入27.90亿元，同比增长61.43%，托管资产余额5.91万亿元，同比增长100.07%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获2012中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖；四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。

（三）注册登记人

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
联系人：崔巍
联系电话：010－59378856
传真：010－59378907
（四）验资机构
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
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：陈熹
经办注册会计师：单峰、陈熹

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金2016年5月17日资产负债表如下：

资产	2016年5月17日	负债和所有者权益	2016年5月17日
	余额		余额
资产：		负债:	
银行存款	205,112,079.66	短期借款	
结算备付金	48,124,181.44	交易性金融负债	
存出保证金	5,731.82	衍生金融负债	
交易性金融资产	1,245,319,164.50	卖出回购金融资产款	293,000,000.00
其中：股票投资		应付证券清算款	196,717,887.68
债券投资	1,245,319,164.50	应付赎回款	2,881,638.88
资产支持证券投资		应付管理人报酬	349,173.35
基金投资		应付托管费	99,763.82
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	3,044.07
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	30,656,498.69	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款	342,308.71	其他负债	347,047.28
其他资产		负债合计	493,398,555.08
		所有者权益：	
		实收基金	887,215,222.70
		未分配利润	148,946,187.04
		所有者权益合计	1,036,161,409.74
资产合计	1,529,559,964.82	负债与持有人权益总计：	1,529,559,964.82

八、基金投资组合

截至2016年5月17日，本基金的投资组合如下：

（一）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	1,245,319,164.50	81.42
	其中：债券	1,245,319,164.50	81.42
	资产支持证券		
3	贵金属投资		
4	金融衍生品投资		
5	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	253,236,261.10	16.56
7	其他各项资产	31,004,539.22	2.03
8	合计	1,529,559,964.82	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

注：截至2016年5月17日，本基金未持有股票。

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

注：截至2016年5月17日，本基金未持有股票。

（四）按券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		
	其中：政策性金融债	91,201,000.00	8.80
4	企业债券	1,015,104,881.20	97.97
5	企业短期融资券	70,427,000.00	6.80
6	中期票据		
7	可转债	68,586,283.30	6.62
8	其他		
9	合计	1,245,319,164.50	120.19

（五）按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细

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	122619	12迁安债	1,000,000	76,030,000.00	7.34
2	122584	12松城开	899,000	75,255,290.00	7.26
3	124238	13通辽投	700,000	58,268,000.00	5.62
4	1380350	13辽门高新债	500,000	54,205,000.00	5.23
5	124314	13筑铁路	499,900	51,854,627.00	5.00

（六）按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：截至2016年5月17日，本基金未持有资产支持证券。

（七）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

截至2016年5月17日，本基金未持有贵金属。

（八）按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：截至2016年5月17日，本基金未持有权证。

（九）本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
3、本期国债期货投资评价
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

（十）投资组合报告附注

1、截至2016年5月17日，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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,731.82
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	30,656,498.69
5	应收申购款	342,308.71
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	31,004,539.22

4、截至2016年5月17日，本基金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	132001	14宝钢EB	5,832,000.00	0.56

5、截至2016年5月17日，本基金前十名股票中存在流通受限情况的说明。

截至2016年5月17日，本基金未持有股票。

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。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（二）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

（一）备查文件目录

1、中国证监会批准鹏华丰利债券型证券投资基金募集的文件
2、《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金合同》
3、《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金托管协议》
4、法律意见书
5、基金管理人业务资格批件、营业执照
6、基金托管人业务资格批件、营业执照

（二）存放地点

深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司。

（三）查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（http://www.phfund.com）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司
2016年5月19日

附件：

鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利、义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

1、分享基金财产收益；
2、参与分配清算后的剩余基金财产；
3、依法申请赎回其持有的基金份额；
4、按照规定要求召开基金份额持有人大会；
5、出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
6、查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7、监督基金管理人的投资运作；
8、对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9、法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1、遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2、交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
3、在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4、不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
5、执行生效的基金份额持有人大会决议；
6、返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、销售机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
7、法律法规和基金合同规定的其他义务。

（二）基金管理人的权利、义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1、自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
2、依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3、发售基金份额；
4、依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5、在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6、根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
7、在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
8、在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
9、自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
10、选择、更换销售机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
11、选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
12、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
13、依法召集基金份额持有人大会；
14、法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2、办理基金备案手续；
3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
7、依法接受基金托管人的监督；
8、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
12、编制中期和年度基金报告；
13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
15、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
18、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
23、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
24、执行生效的基金份额持有人大会决议；
25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（三）基金托管人的权利、义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1、依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
2、监督基金管理人对本基金的投资运作；
3、自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
4、在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
5、根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会；
6、依法召集基金份额持有人大会；
7、按规定取得基金份额持有人名册资料；
8、法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

1、安全保管基金财产；
2、设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3、对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
7、保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
8、对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
9、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
10、按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
11、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
12、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
13、按照规定监督基金管理人的投资运作；
14、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15、依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
16、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
17、因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
18、基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
19、参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
21、执行生效的基金份额持有人大会决议；
22、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
23、建立并保存基金份额持有人名册；
24、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

（二）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上（含10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时（在分级运作期内，依据本基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、新任基金管理人和基金托管人提名权的单独或合计持有本基金总份额10%以上基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有丰利A和丰利B各自的基金总份额10%以上基金份额的基金份额持有人”），应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》，基金合同另有约定的除外；
（2）更换基金管理人；
（3）更换基金托管人；
（4）转换基金运作方式，但本基金分级运作期届满后转为上市开放式基金（LOF）除外；
（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
（6）变更基金类别；
（7）本基金与其他基金的合并；
（8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；
（9）变更基金份额持有人大会程序；
（10）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
（11）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费、销售服务费；
（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率；
（4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
（5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
（6）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(三)召集人和召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集；

4、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；

5、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰；

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(四)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；
（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地