（上接B78版）

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：北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层
法人代表：梁越
电话：010-58845311
联系人：王海烨
客户服务热线：4008-980-618
网址：www.chtfund.com
（97）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：021-20691926
联系人：唐诗洋
客户服务热线：400-820-2899
网址：www.erichfund.com
（98）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一号环球财讯中心A座5层
法人代表：彭运华
电话：010-59336519
联系人：孙雯
客户服务热线：010-59336512
网址：www.jnlc.com
（99）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：陈勇军
客户服务热线：0755-83999907
网址：www.jinqianwo.cn
（100）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：021-33323999-8048
联系人：李栋
客户服务热线：400-821-3999
网址：www.chinapnr.com
（101）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：杨赟
电话：400-166-1188
联系人：张燕
客户服务热线：400-166-1188
网址：http://8.jrj.com.cn
（102）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
网址：www.leadbank.com.cn
（103）上海中正达广投资管理有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法人代表：黄欣
电话：13774232592
联系人：戴珉微
客户服务热线：400-6767-523
网址：www.zzwealth.cn
（104）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
客户服务热线：400-068-0058
网址：http://www.jincheng-fund.com
（105）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：4000-466-788
网址：www.66zichan.com
（106）中经北证（北京）资产管理有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
办公地址：北京市西城区北礼士路甲129号文化创新工场四层404
法人代表：徐福星
电话：010-68292745-803
联系人：徐娜
客户服务热线：400 600 0030
网址：www.bzfunds.com
（107）大泰金石投资管理有限公司
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：021-22267994
联系人：朱海涛
客户服务热线：400-928-2266
网址：http://www.dtfortune.com/
（108）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室
办公地址：北京海淀区中关村海淀北2街10号泰鹏大厦12楼
法人代表：张琪
电话：18501046366
联系人：付文红
客户服务热线：010-62675369
网址：www.xincai.com
（109）浙江国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：0571-88911818-8554
联系人：刘宁
客户服务热线：4008-773-772
网址：www.5ifund.com
（110）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
法人代表：赵荣春
电话：010-56183769
联系人：车倩倩
客户服务热线：400-893-6885
网址：www.dyxtw.com
（111）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：010-85097570
联系人：余永捷
客户服务热线：400-021-8850
网址：http://www.harvestwm.cn/
（112）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龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法人代表：林卓
电话：0411-88891212-111
联系人：孙先帅
客户服务热线：400-6411-999
网址：www.taichengcaifu.com
（二）注册登记机构
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
法定代表人：井贤栋
电话：（022）83865560
传真：（022）83865563
联系人：薄贺龙
（三）律师事务所和经办律师
名称：天津嘉德恒时律师事务所
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10层1009-1010
法定代表人：孟卫民
电话：022-83865255
传真：022-83865266
联系人：续宏帆
经办律师：韩刚、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：021-61238800
联系人：周祎
经办注册会计师：薛竞、周祎

四、基金的名称

本基金名称：天弘永利债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：债券型

六、基金的投资目标

在充分控制风险和保持资产良好流动性的前提下，力争为基金份额持有人获取较高的投资回报。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于固定收益类证券，包括国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转债（含分离交易可转债）、资产支持证券、央行票据、短期融资券、回购等固定收益证券品种，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。为提高基金收益水平，本基金可以参与新股申购及二级市场股票投资。

本基金对债券类资产及中国证监会批准的允许基金投资的其他固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的80%，对股票等权益类证券的投资比例不超过基金资产的20%，对现金和到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资策略

1、资产配置

本基金通过对宏观经济自上而下的分析以及对微观面自下而上的分析，对宏观经济发展环境、宏观经济运行状况、货币政策和财政政策的变化、市场利率走势、经济周期、企业盈利状况等作出研判，从而确定整体资产配置，即债券、股票、现金及回购等的配置比例。本基金的股票投资将以新股申购为主，对于二级市场股票投资持谨慎态度。本基金将在充分重视本金安全的前提下，为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。

2、固定收益类证券投资策略

（1）债券资产配置

本基金通过对宏观经济、货币政策和债券市场的分析判断，把握市场利率的运行态势，根据债券市场收益率曲线的整体运动方向制定具体的投资策略，在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上，充分运用各种套利策略提升组合的持有期收益率，实现基金资产的保值增值。

①久期选择

本基金通过对宏观经济状况和货币政策的分析，根据中长期的宏观经济走势和经济周期性特征，对债券市场走势作出判断，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期限结构配置

在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构。通过对债券市场微观因素的分析，形成对未来收益率曲线形态变化的预期，相应地选择哑铃型、子弹型或阶梯型债券组合。

本基金主要考虑的债券市场微观因素包括：收益率曲线、历史期限结构、新债发行、回购及市场折借利率等。

③债券类属配置

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））的扩大和收窄的预期，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间相对价值变化所带来的投资收益。

(2)个债选择

①普通债券的选择

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、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

为控制基金债券投资的信用风险，本基金投资的企业债需经国内评级机构进行信用评估，要求其信用评级为投资级以上。如果债券获得主管机构的豁免评级，本基金根据对债券发行人的信用风险分析，决定是否将该债券纳入基金的投资范围。

另外，本基金还将根据债券市场的动态变化，采取多种灵活的动态增强型策略，如骑乘策略、息差策略、利差策略等，以获取超额收益。

②含权债券的选择

含权债券主要包括两类债券品种：含赎回或回售选择权的债券、含可转换为股本选择权的可转换公司债券。

本基金利用债券市场收益率数据，运用利率模型，计算含赎回或回售选择权的债券的期权调整利差（OAS），作为此类债券投资估值的主要依据。

可转换公司债券是一种介于股票和债券之间的债券衍生投资品种，投资者既可以获得债券投资的固定收益，也可以分享股票价格上涨所带来的投资回报。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转债的纯债价值和到期收益率来判断可转债的债性，以增强本金投资的安全性；利用可转债溢价率来判断可转债的股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。

为保持债券基金的收益风险特征，本基金可转换公司债券投资不超过基金资产净值的20%。

③资产支持证券的选择

本基金通过分析资产支持证券对应资产的资产特征，来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支付，并利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。同时还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，控制资产支持证券投资的风险，以获取较高的投资收益。

3、权益类证券投资策略

（1）新股申购策略

本基金可参与一级市场新股申购或增发新股等，包括在新股冻结期限内所发生的送股、配股、权证等权益投资。本基金管理人将利用公司的研究体系、对新股的行业属性和基本面作出判断，利用财务分析对公司的投资价值作出评估，从而进行合理询价。本基金将结合公司基本面、市场资金利率水平和可能的中签率作出是否参与新股申购的判断，通过新股申购主动优选股票，以获取一级市场与二级市场的价差收益。

（2）二级市场股票投资策略

当本基金管理人判断市场出现明显的投资机会时，本基金可在授权范围内直接参与股票二级市场投资，以获取超额收益。本基金股票资产主要投资于两类公司：一是主营业务收入稳定增长、行业竞争优势明显、具有良好的现金分红纪录或现金分红潜力的优质上市公司。二是价值明显低估的公司。本基金从二级市场买入的股票必须全部来自于公司的核心股票库。

对于通过新股申购、可转债转股获得的股票，如不符合个股选择标准，本基金将在该股票上市后1个月内卖出。

（3）权证投资策略

本基金对权证的投资建立在对标的证券和组合收益进行分析的基础之上，主要用于锁定收益和控制风险。

九、业绩比较基准

中债新综合指数。本基金业绩比较基准为“中债新综合指数”。

中债新综合指数隶属于中债总指数族分类，该指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行的可流通债券，是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，由于样本债券涵盖的范围广，中债新综合指数可以作为具备一般性的业绩比较基准。

随着我国债券市场的发展，将来如有更合适的指数推出，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成，业绩比较基准变更需经基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案。

十、风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券市场中的较低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，高于货币市场基金。

十一、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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年5月16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2016年3月31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

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	70,151,467.27	1.60
	其中：股票	70,151,467.27	1.60
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	4,133,838,870.64	94.05
	其中：债券	4,133,838,870.64	94.05
	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	83,495,006.78	1.90
8	其他资产	107,996,081.84	2.46
9	合计	4,395,481,426.53	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	58,002,142.11	1.73
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	10,199,825.16	0.30
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	1,949,500.00	0.06
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	70,151,467.27	2.09

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000933	神火股份	3,299,970	18,941,827.80	0.56
2	300296	利亚德	584,400	13,867,812.00	0.41
3	000028	国药一致	159,922	10,199,825.16	0.30
4	000932	华菱钢铁	2,500,000	9,875,000.00	0.29
5	000959	首钢股份	2,000,000	9,400,000.00	0.28
6	002444	巨星科技	349,941	5,917,502.31	0.18
7	300070	碧水源	50,000	1,949,500.00	0.06

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	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	170,108,000.00	5.07
	其中：政策性金融债	170,108,000.00	5.07
4	企业债券	1,829,109,870.64	54.55
5	企业短期融资券	1,709,570,000.00	50.98
6	中期票据	425,051,000.00	12.68
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	4,133,838,870.64	123.28

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

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	占基金资产净值比例（%）
1	011599741	15悦达SCP002	2,000,000	201,100,000.00	6.00
2	041555037	15华电煤业CP001	1,600,000	160,912,000.00	4.80
3	101459024	14桐乡城建MTN001	1,000,000	111,980,000.00	3.34
4	1480528	14世园投债	1,000,000	107,660,000.00	3.21
5	041578002	15宿迁经开CP001	1,000,000	100,760,000.00	3.00

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、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

（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。

（2）基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

（3）其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	122,125.90
2	应收证券清算款	9,968,583.51
3	应收股利	—
4	应收利息	94,042,374.98
5	应收申购款	3,862,997.45
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	107,996,081.84

（4）本基金本报告期末处于转股期的可转换债券

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000932	华菱钢铁	9,875,000.00	0.29	筹划重大事项

（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。

十二、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。

基金业绩数据截至2016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

1、天弘永利债券A

阶段	净值增长率A①	净值增长率标准差A②	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
2008/04/18-2008/12/31	7.36%	0.19%	7.51%	0.12%	-0.15%	0.07%
2009/01/01-2009/12/31	0.57%	0.25%	0.27%	0.06%	0.30%	0.19%
2010/01/01-2010/12/31	5.00%	0.13%	2.00%	0.07%	3.00%	0.06%
2011/01/01-2011/12/31	-1.32%	0.15%	3.79%	0.06%	-5.11%	0.09%
2012/01/01-2012/12/31	7.39%	0.07%	4.03%	0.04%	3.36%	0.03%
2013/01/01-2013/12/31	1.60%	0.11%	1.78%	0.05%	-0.18%	0.06%
2014/01/01-2014/12/31	9.68%	0.19%	9.41%	0.16%	0.27%	0.03%
2015/01/01-2015/12/31	15.19%	0.18%	6.50%	0.07%	8.69%	0.11%
2016/01/01-2016/03/31	1.00%	0.10%	1.14%	0.07%	-0.14%	0.03%
2008/04/18-2016/03/31	55.75%	0.17%	42.36%	0.09%	13.39%	0.08%

2、天弘永利债券B

阶段	净值增长率B①	净值增长率标准差B②	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
2008/04/18-2008/12/31	7.70%	0.19%	7.51%	0.12%	0.19%	0.07%
2009/01/01-2009/12/31	1.01%	0.25%	0.27%	0.06%	0.74%	0.19%
2010/01/01-2010/12/31	5.44%	0.13%	2.00%	0.07%	3.44%	0.06%
2011/01/01-2011/12/31	-0.91%	0.15%	3.79%	0.06%	-4.70%	0.09%
2012/01/01-2012/12/31	7.89%	0.07%	4.03%	0.04%	3.86%	0.03%
2013/01/01-2013/12/31	2.03%	0.11%	1.78%	0.05%	0.25%	0.06%
2014/01/01-2014/12/31	10.17%	0.19%	9.41%	0.16%	0.76%	0.03%
2015/01/01-2015/12/31	15.50%	0.17%	6.50%	0.07%	9.00%	0.10%
2016/01/01-2016/03/31	1.09%	0.10%	1.14%	0.07%	-0.05%	0.03%
2008/04/18-2016/03/31	60.95%	0.17%	42.36%	0.09%	18.59%	0.08%

注：自2015年10月1日起，本基金的业绩比较基准由"中信标普全债指数"变更为"中债新综合指数"，详情请参阅本公司于2015年9月24日披露的《天弘基金管理有限公司关于变更天弘永利债券型证券投资基金业绩比较基准并相应修改基金合同部分条款的公告》。

十三、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、本基金从A类基金份额基金财产中计提销售服务费；
4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、银行汇划费用；
8、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。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（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

基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%的年费率计提。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 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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，基金托管人复核后于次月首日起两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、休息日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

基金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

基金托管费每日计提，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，基金托管人复核后于次月首日起两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、休息日等，支付日期顺延。

3、基金的销售服务费

A类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。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B类基金份额不收取销售服务费。

在通常情况下，本基金A类基金份额的销售服务年费率为0.4%，计算方法如下：基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H为A类基金每日应计提的销售服务费

E为前一日A类基金资产净值

基金的销售费每日计提，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，支付日期顺延。

上述（一）中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

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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
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）基金管理费和基金托管费的调整

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或基金托管费率、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3个工作日在至少一种指定报刊及基金管理人网站上刊登公告并报中国证监会备案。

（五）基金税收

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。

十四、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2015年12月1日公告的《天弘永利债券型证券投资基金招募说明书（更新）》进行了更新，主要更新的内容如下：

1、更新了“三、基金管理人”中相关内容。
2、更新了“四、基金托管人”中相关内容。
3、更新了“五、相关服务机构”中相关内容。
4、更新了“八、基金份额的申购、赎回与转换”中相关内容。
5、更新了“十一、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。
6、更新了“十二、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。
7、更新了“二十四、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
二〇一六年六月一日

A股代码：601009 A股简称：南京银行 编号：2016-031
优先股代码：360019 优先股简称：南银优1

南京银行股份有限公司关于2015年度利润分配及资本公积转增股本实施公告

特别提示：

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

重要内容提示：

●每10股派送现金股利4元人民币（含税），即每股派发现金0.4元（含税）；以资本公积向全体股东每10股转增8股，即每股转增0.8股。

●扣税前每股现金分红0.40元；无限售条件流通股的自然人股东和证券 投资基金在公司派发股息红利时暂不扣缴个人所得税；合格境外机构投资者（“QFII”）股东，香港中央结算有限公司账户、有限售条件流通股的个人股东及证券投资基金按10%税率代扣代缴所得税，税后每股现金红利为0.36元；对于其他机构投资者和法人股东，公司将不代扣代缴企业所得税，实际派发现金红利为每股0.40元。

●股权登记日：2016年6月6日（星期一）

●除权除息日：2016年6月7日（星期二）

●现金红利发放日：2016年6月7日（星期二）

●新增无限售条件流动股份上市日：2016年6月8日（星期三）

一、通过利润分配方案的股东大会届次和日期

南京银行股份有限公司（以下简称“公司”） 利润分配预案已经2016年5月24日召开的公司2015年度股东大会审议通过，股东大会决议公告刊登在2016年5月25日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)和公司网站（www.njcb.com.cn）。

二、利润分配方案

1、发放年度：2015年度

2、发放范围：截止2016年6月6日（股权登记日）下午上海证券交易所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（以下简称“中登上海分公司”）登记在册的本公司全体股东。

3、本次分配以2015年12月31日普通股总股本3,365,955,526股为基数，向全体普通股股东每10股派送现金股利4元人民币（含税），合计派发现金股利13.46亿元；以资本公积按每10股转增8股，合计转增2,692,764,420股。

三、具体实施日期

股权登记日：2016年6月6日（星期一）

除权除息日：2016年6月7日（星期二）

现金红利发放日：2016年6月7日（星期二）

新增无限售条件流动股份上市日：2016年6月8日（星期三）

四、分派对象

截至2016年6月6日（股权登记日）下午上海证券交易所收市后，在中登上海分公司登记在册的本公司全体普通股股东。

五、利润分配实施办法

1.个人股东及证券投资基金持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额，实际税负为20%；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额，实际税负为10%。

2.对个人股东及证券投资基金持股1年以内（含1年）的，公司暂不扣缴个人所得税；待转让股票时，中登上海分公司根据其持股期限计算应纳税额，由证券公司等股份托管机构从资金账户中扣收并划付中登上海分公司，中登上海分公司应于次月5个工作日内划付公司，公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳。

3. 对于持有公司有限售条件流通股的个人股东及证券投资基金，根据《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税[2012]85 号）有关规定，按照 10%的税率代扣所得税，扣税后每股实际派发现金股息0.36元。

4. 对于持有公司A股股份的合格境外机构投资者（QFII），根据《企业所得税法》以及《企业所得税法实施条例》的规定，凡中国企业向非居民企业股东派发股息时，需由中国企业按10%的税率代扣代缴所得税。税后实际每股派发现金红利0.36元。如果QFII股东涉及享受税收协定（安排）待遇的，按照《关于中国居民企业向QFII支付股息、红利、利息代扣代缴企业所得税有关问题的通知》（国税函〔2009〕47 号）的规定执行。

5. 对于香港联交所投资者（包括企业和个人）投资上海证券交易所公司 A 股股票（“沪股通”），其股息红利将由公司通过中登上海分公司按股票名义持有人账户以人民币派发，扣税根据《财政部、国家税务总局、证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税[2014]81号）（“《财税[2014]81号通知》”）执行，公司按照10%的税率代扣现金红利所得税，扣税后每股实际派发现金股息0.36 元。

6. 对于其他属《企业所得税法》项下居民企业含义的持有公司A股的投资者，公司不代扣代缴所得税，每股派发现金红利0.40元。

7、除以下所列股东外，公司股东的现金红利委托中登上海分公司通过其资金清算系统向股权登记日登记在册并在上海证券交易所各会员单位办理了指定交易的股东派发。已办理全面指定交易的投资者可于红利发放日在其指定的证券营业部领取现金红利，未办理指定交易的股东红利暂由中登上海分公司保管，待办理指定交易后再进行派发。

BNP PARIBAS、南京紫金投资集团有限责任公司、南京高科股份有限公司、南京市国有资产投资管理控股（集团）有限责任公司、南京纺织产业(集团)有限公司、江苏省国信资产管理集团有限公司、江苏省盐业集团有限责任公司、南京市白下区国有资产经营中心、南京市煤气总公司、南京市雨花台区国有资产经营中心由本公司直接发放。

8、本次转增的资本公积来源为公司股本溢价发行形成的资本公积金，公司本次资本公积金转增股本不扣税。本次实施资本公积金转增股本，按照中登上海分公司的有关规定，将所分派股份直接计入股东账户。

六、股本结构变动表

单位：股		本次变动前	变动数	本次变动后
有限售条件的流通股份	国有法人持有股份	39,702,234	31,761,787	71,464,021
	境外法人持有股份	124,069,478	99,255,582	223,325,060
	其他持有股份	233,250,620	186,600,496	419,851,116
	有限售条件的流通股份合计	397,022,332	317,617,865	714,640,197
无限售条件的流通股份	A股	2,968,933,194	2,375,146,555	5,344,079,749
	无限售条件的流通股份合计	2,968,933,194	2,375,146,555	5,344,079,749
股份总额		3,365,955,526	2,692,764,420	6,058,719,946

七、按新增股本总额摊薄计算的2015年度每股收益

本次资本公积转增股本方案实施后，按照实施后新股本总额6,058,719,946股摊薄计算的公司2015年度每股收益为1.16元。

八、有关咨询办法

1、咨询机构：公司董事会办公室
2、地址：南京市中山路288号南京银行股份有限公司董事会办公室（公司总部21楼）
3、咨询电话：（025）86775068 (025)86775058

九、备查文件

公司2015年度股东大会决议及公告

特此公告。

南京银行股份有限公司董事会
2016年5月31日

证券简称：恒康医疗 证券代码：002219 公告编号：2016-79

恒康医疗集团股份有限公司关于签订《股权收购之尽职调查备忘录》的公告

特别提示：

1、本次签订的《股权收购之尽职调查备忘录》（以下简称"备忘录"），为江苏瑞桓建设有限公司管理人与公司就收购泗阳县人民医院（以下简称"标的医院"）股权做出的合作意愿和基本原则约定，最终能否实现股权收购存在不确定性，敬请投资者注意投资风险。

2、本次交易不涉及关联交易，也不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的上市公司重大资产重组。本次签订的备忘录已获江苏瑞桓建设有限公司债权人委员会会议通过。

一、概述

2016年5月31日，恒康医疗集团股份有限公司（以下简称"恒康医疗"或"公司"）与江苏瑞桓建设有限公司管理人（以下简称"管理人"）签署了备忘录，备忘录约定公司有意向收购江苏瑞桓建设有限公司持有的泗阳县人民医院78%的股权，并对该医院进行尽职调查，在公司尽调期间管理人不得与任何第三方就医院权益转让、租赁达成协议。备忘录的签署有利于实现公司对泗阳县人民医院的收购，扩大公司医疗服务规模，实现公司发展战略，提升公司核心竞争力。

二、合作对方基本情况

合作方名称：江苏瑞桓建设有限公司管理人

负责人：郭少伟

住所：江苏省南京市汉中路169号金丝利国际大厦11、12楼

江苏高的律师事务所为南京市中级人民法院依法指定的江苏瑞桓建设有限公司管理人，管理人依法具有管理和处分江苏瑞桓建设有限公司财产的法定职责。

三、标的医院基本情况

标的医院名称：泗阳县人民医院

住所：泗阳县众兴镇兴中路26号

法定代表人：刘建军

股权结构：江苏瑞桓建设有限公司持有标的医院78%的股权

泗阳县人民医院成立于1945年，为二级甲等综合医院，核定床位680张，年门诊量约35万人次，年住院量约2.8万人次，为徐州医学院教学医院、省人民医院技术支持医院、南医大二附院分院、国家爱婴医院。医院职工总数1053人，其