(上接B81版)

办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人：廖海
经办律师：梁丽金、刘佳
电话：(021)51150298
传真：(021)51150398

四、会计师事务所和经办注册会计师
名称：安永华明会计师事务所
注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼
法定代表人：葛明
联系电话：021-22288888
传真：021-22280000
联系人：徐艳
经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

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天盈A、天盈B两级份额，所募集的基金资产合并运作。

(一)基金份额配比

天盈A、天盈B的份额配比原则上不超过7:3。

本基金募集设立时，天盈A、天盈B的份额配比将不超过7:3。

本基金《基金合同》生效之日起3年内，天盈A自《基金合同》生效之日起每满6个月开放一次，天盈B封闭运作并上市交易。在天盈A的每次开放日，基金管理人将对天盈A进行基金份额折算，天盈A的基金份额净值调整为1.000元，基金份额持有人持有的天盈A份额数按折算比例相应增减。为此，在天盈A的单个开放日，如果天盈A没有赎回或者净赎回份额极小，天盈A、天盈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；如果天盈A的净赎回份额较多，天盈A、天盈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。

(二)天盈A的运作

1、收益率

天盈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：

天盈A的年收益率(单利)=1.4×1年期银行定期存款利率

天盈A的年收益率计算按照四舍五入的方法保留到以百分比计算的小数点后第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天盈A的首次年收益率；在天盈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天盈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3.25%，则天盈A的年收益率(单利)为：

天盈A的年收益率(单利)=1.4×3.25%=4.55%

2、开放日

天盈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。

天盈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。

天盈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。如果本基金《基金合同》于2011年5月20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2011年11月19日、2012年5月19日、2012年11月19日，以此类推。假设2011年11月19日为非工作日，在其之前的最后一个工作日为2011年11月18日，则第一次开放日为2011年11月18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，基金管理人将对天盈A进行基金份额折算，天盈A的基金份额净值调整为1.000元，基金份额持有人持有的天盈A份额数按折算比例相应增减。

天盈A的基金份额折算基准日与开放日为同一个工作日。

天盈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《基金合同》生效之日起3年内，天盈A的份额余额原则上不得超过7/3倍天盈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。

(三)天盈B的运作

1、天盈B封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回。

天盈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，在符合基金上市交易条件下，天盈B将申请在深圳证券交易所上市交易。

3、本基金在扣除天盈A的应计收益后的全部剩余收益归天盈B享有，亏损以天盈B的资产净值为限由天盈B承担。

(四)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《基金合同》生效之日起3年内，T日基金份额的余额数量为天盈A和天盈B的份额总额；本基金《基金合同》生效后3年期满并转为上市开放式基金(LOF)后，T日基金份额的余额数量为该LOF基金的份额总额。

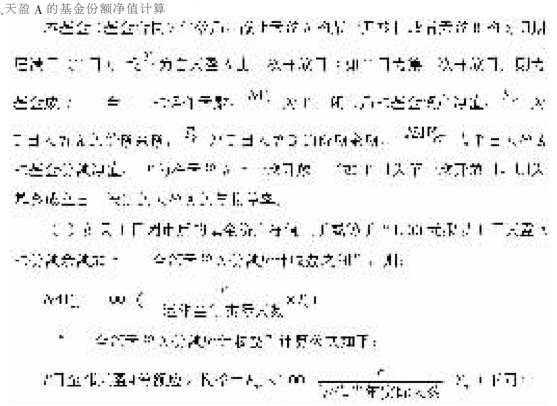
本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

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。

(五)天盈A和天盈B的基金份额净值计算

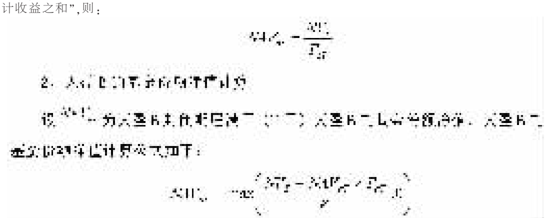
本基金《基金合同》生效后，在天盈A的开放日计算天盈A的基金份额净值；在天盈B的封闭期届满日分别计算天盈A和天盈B的基金份额净值。

1、天盈A的基金份额净值计算



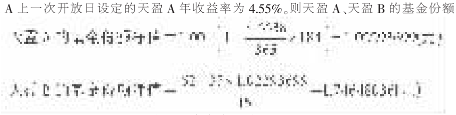
以上各式中，运作当年实际天数指天盈A上一次开放日(如T日为第一次开放日，则为基金成立日)所在年度的实际天数，下同。

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



天盈A、天盈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。

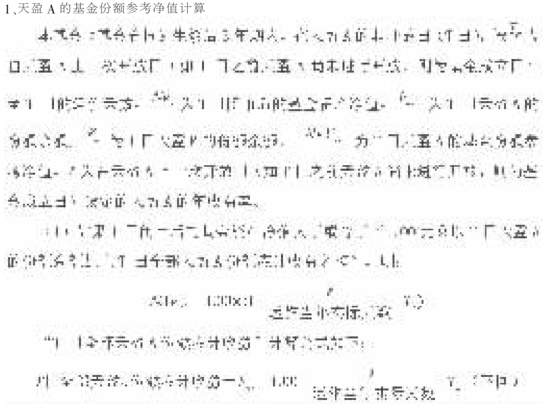
例2：本基金《基金合同》生效后3年期届满日，设自天盈A上一次开放日起的运作天数为184天，基金运作当年的实际天数为365天，基金资产净值为62亿元，天盈A、天盈B的份额余额分别为35亿份和15亿份，天盈A上一次开放日设定的天盈A年收益率为4.55%。则天盈A、天盈B的基金份额净值计算如下：



(六)天盈A和天盈B的基金份额参考净值计算

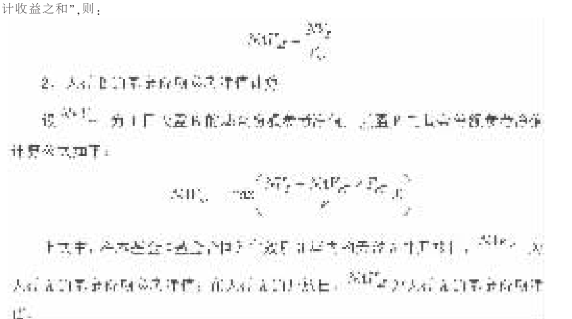
本基金《基金合同》生效后3年期内，基金管理人在计算基金资产净值的基础上，采用"虚拟清算"原则分别计算并公告天盈A和天盈B的基金份额参考净值，其中，天盈A的基金份额参考净值计算日不包括天盈A的开放日。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

1、天盈A的基金份额参考净值计算



以上各式中，运作当年实际天数指天盈A上一次开放日(如T日之前天盈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。

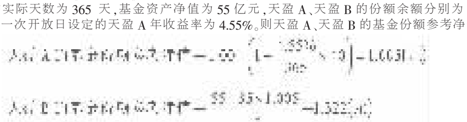
(2)如果T日闭市后的基金资产净值小于"1.00元乘以T日天盈A的份额余额加上T日全部天盈A份额应计收益之和"，则：



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

T日的天盈A和天盈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《基金合同》生效之日起3年内，设自天盈A上一次开放日起的运作天数为40天，基金运作当年的实际天数为365天，基金资产净值为55亿元，天盈A、天盈B的份额余额分别为35亿份和15亿份，天盈A上一次开放日设定的天盈A年收益率为4.55%。则天盈A、天盈B的基金份额参考净值计算如下：



二、《基金合同》生效后3年期届满时的基金份额转换

基金《基金合同》生效后3年期届满，本基金将按照《基金合同》约定转换为上市开放式基金(LOF)，天盈A、天盈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。

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届时发布的相关公告。

五、基金的名称

富国天盈分级债券型证券投资基金(基金名称已变更为"富国天盈债券型证券投资基金(LOF)")

六、基金的类型

债券型

七、天盈A的基金份额折算

本基金《基金合同》生效之日起3年内，天盈A将按以下规则进行基金份额折算。

一、折算基准日

本基金《基金合同》生效之日起3年内，天盈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。

天盈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招募说明书第六部分中"天盈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天盈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，天盈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天盈A的份额数按照折算比例相应增减。

天盈A的基金份额折算公式如下：

天盈A的折算比例=折算日折算前天盈A的基金份额净值/1.000

天盈A经折算后的份额数=折算前天盈A的份额数×天盈A的折算比例

天盈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2位，由此产生的误差计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算日折算前天盈A的基金份额净值、天盈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的相关业务规定暂停天盈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日在指定媒体公告，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日内在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

八、基金转型后的基金转换

一、基金转型后的基金存续形式

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"富国天盈债券型证券投资基金(LOF)"。天盈A、天盈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、基金转型时天盈A的处理方式

本基金《基金合同》生效后3年期届满日，基金份额持有人可选择将其持有的天盈A份额赎回、或是转入"富国天盈债券型证券投资基金(LOF)"。投资者不选择的，其持有的天盈A份额将被默认为转入"富国天盈债券型证券投资基金(LOF)"份额。

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年期届满日与天盈B的封闭期届满日相同。

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天盈A的基金份额持有人作出选择申请，天盈A的基金份额持有人可在届时公告规定的时间内按照公告规定的方式作出选择申请。

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，天盈A、天盈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：

天盈A份额(或天盈B份额)的转换比率=份额转换基准日天盈A(或天盈B)的基金份额净值/1.000

天盈A(或天盈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天盈A(或天盈B)的份额数×天盈A份额(或天盈B份额)的转换比率

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

天盈A、天盈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。本基金完成份额转换后已于2014年6月4日开始上市交易，并同时开始办理申购与赎回业务。

4、份额转换的公告

(1)本基金《基金合同》生效后3年期届满时，本基金将转换为上市开放式基金(LOF)，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)天盈A、天盈B进行份额转换结束后，基金管理人应在2日内在指定媒体公告，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《基金合同》生效后3年期届满，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。

九、基金的投资目标

本基金在追求基金资产长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

十、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具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证券品种(但须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A股股票(包括中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票)的新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种(但须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，本基金应在其可交易之日起的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的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

十一、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。

(1)整体资产配置策略

通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况，以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，在整体资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

(2)类属资产配置策略

在整体资产配置策略的指导下，根据资产的风险来源、收益率水平、利息税务处理以及市场流动性等因素，将市场细分为普通债券(含国债、金融债、央行票据、企业债、短期融资券等)、附权债券(含可转换公司债、各类附权债券等)、资产证券化产品等子市场，采取积极投资策略，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权数。

(3)明细资产配置策略

在明细资产配置上，首先根据明细资产的剩余期限、资产信用等级、流动性指标决定是否纳入组合；其次，根据个别债券的收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)与剩余期限的配比，对照基金的收益要求决定是否纳入组合；最后，根据个别债券的流动性指标(发行总量、流通量、上市时间)，决定投资总量。

2、普通债券投资策略

本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

(1)久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期，有效的控制整体资产风险。

(2)期限结构配置是在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

(3)信用风险控制是通过对宏观经济形势、基准利率走势、资金面状况、行业以及个券信用状况的研判，积极主动发掘收益充分覆盖风险，甚至在覆盖之余还存在超额收益的投资品种；同时通过行业及个券信用等级限定、久期控制等方式有效控制投资信用风险。

(4)跨市场套利根据不同债券市场间的运行规律和风险特性，构建和调整债券债组合，提高投资收益，实现跨市场套利。

(5)相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断，选择合适的交易时机，增持相对低估、价格将上升的债券，减持相对高估、价格将下降的债券。

3、附权债券投资策略

附权债券指对债券发行体授予某种期权，或者赋予债券投资者某种期权，从而使债券发行体或投资者有了某种灵活的选择余地，从而增强该种金融工具对不同发行体融资的灵活性，也增强对各类投资者的吸引力。当前附权债券的主要种类有可转换公司债券、分离交易可转换公司债券以及含赎回或回售选择权的债券等。

(1)可转换公司债券投资策略

可转换公司债券不同于一般的企业(公司)债券，其投资人具有在一定条件下转股和回售的权利，因此其理论价值应当等于作为普通债券的基础价值加上可转换公司债内含期权价值，是一种既具有债性，又具有股性的混合债券产品，具有抵御价格下行风险，分享股票价格上涨收益的特点。

可转换公司债券最大的优点在于，可以用较小的本金损失，博取股票上涨时的巨大收益。可以充分运用可转换公司债券在风险和收益上的非对称性分布，买入低转换溢价率的债券，并持有的投资策略，只要在可转换公司债券的存续期内，发行转债的公司股票价格上升，则投资就可以获得超额收益。

可转换公司债券可以按照约定价格转换为上市公司的股票，因此在日常交易过程中可能会出现可转换公司债券市场与股票市场之间的套利机会。本基金持有的可转换公司债券可以转换成股票。基金管理人在日常交易过程中，会密切关注可转换公司债券市场与股票市场之间的互动关系，恰当的选择时机进行套利。

(2)其它附权债券投资策略

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。

分离交易可转换公司债券，是认股权证和公司债券的组合产品，该种产品中的公司债券和认股权证可在上市后分别交易，即发行时是组合在一起的，而上市后则自动拆分成公司债券和认股权证。本基金因认购分离交易可转换公司债券所获得的认股权证自可交易之日起30个交易日内全部卖出，分离交易可转换公司债券上市后分离出的公司债券的投资按照普通债券投资策略进行管理。

4、资产证券化产品投资策略

证券化是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产，通过一定的结构化安排，对资产中的风险与收益进行分离组合，进而转换成可以出售、流通，并带有固定收入的证券的过程。

资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产证券化产品。

5、新股申购策略

为保证新股发行成功，新股发行一级市场价格通常相对二级市场价格存在一定的折价。在中国证券市场发展历程中，参与新股申购是一种风险低、收益稳定的投资行为，为投资人带来较高的投资回报。本基金根据新股发行人的基本情况，以及对认购中签率和新股上市后表现的预期，谨慎参与新股申购，获取股票一级市场与二级市场的价差收益。申购所得的股票在可上市交易后30个交易日内全部卖出。

6、投资决策与交易机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例、组合基准久期、回购的最高比例等重大投资决策。

基金经理在投资决策委员会确定的投资范围内制定并实施具体的投资策略，向集中交易室下达投资指令。

集中交易室设立债券交易员，负责执行投资指令，就指令执行过程中的问题及市场面的变化对指令执行的影响等问题及时向基金经理反馈，并可提出基于市场面的具体建议。集中交易室同时负责各项投资限制的监控以及本基金资产与公司旗下其他基金之间的公平交易控制。

7、投资程序

投资决策委员会负责决定基金投资的重大决策。基金经理在授权范围内，制定具体的投资组合方案并执行。集中交易室负责执行投资指令。

(1)基金经理根据市场的趋势、运行的格局和特点，并结合本基金合同、投资风格拟定投资策略报告。

(2)投资策略报告提交给投资决策委员会。投资决策委员会审批决定基金的投资比例、大类资产分布比例、组合基准久期、回购比例等重要事项。

(3)基金经理根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、组合基准久期和个券投资分布方式等。

(4)对已投资品种进行跟踪，对投资组合进行动态调整。

十二、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。

十三、基金的风险收益特征

从基金资产整体运作来看，本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

从本基金所分离的两类基金份额来看，由于本基金资产及收益的分配安排，天盈A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征；天盈B份额则表现出较高风险、收益相对较高的特征。

十四、基金的投资组合报告

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	453,073,814.90	96.75
	其中：债券	453,073,814.90	96.75
	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	2,381,029.32	0.51
7	其他资产	12,837,493.39	2.74
8	合计	468,292,337.61	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

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

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

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	60,024,000.00	13.31
	其中：政策性金融债	60,024,000.00	13.31
4	企业债券	246,831,833.30	54.72
5	企业短期融资券	120,497,000.00	26.71
6	中期票据	10,910,000.00	2.42
7	可转债(可交换债)	14,810,981.60	3.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	453,073,814.90	100.43

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

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	041553076	15华能集CP003	300,000	30,132,000.00	6.68
2	011522006	15神华SCP006	300,000	30,114,000.00	6.68
3	011550005	15商飞SCP005	300,000	30,078,000.00	6.67
4	150215	15国开15	300,000	30,015,000.00	6.65
5	150206	15国开06	300,000	30,009,000.00	6.65

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：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

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	-
股指期货投资本期收益(元)	-
股指期货投资本期公允价值变动(元)	-

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	-
国债期货投资本期收益(元)	-
国债期货投资本期公允价值变动(元)	-

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

(3)本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

(1)申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形。

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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2)申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金本报告期末未持有前十名股票超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	33,197.84
2	应收证券清算款	1,298,808.14
3	应收股利	-
4	应收利息	11,175,476.97
5	应收申购款	330,010.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,837,493.39

(4)报告期末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	113008	电气转债	7,129,200.00	1.58
2	110030	格力转债	3,315,600.00	0.74
3	132001	14宝钢EB	2,465,381.60	0.55
4	128009	歌尔转债	1,900,800.00	0.42

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

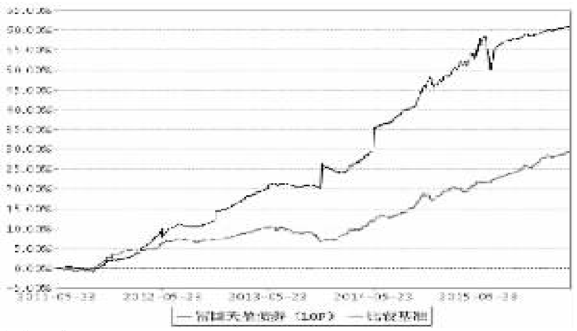
十五、基金的业绩

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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、富国天盈债券型证券投资基金(LOF)历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2011.5.23-2011.12.31	2.52%	0.13%	3.89%	0.10%	-1.37%	0.03%
2012.1.1-2012.12.31	12.20%	0.19%	3.60%	0.06%	8.60%	0.13%
2013.1.1-2013.12.31	8.73%	0.33%	-0.47%	0.09%	9.20%	0.24%
2014.1.1-2014.12.31	17.02%	0.32%	10.34%	0.11%	6.68%	0.21%
2015.1.1-2015.12.31	9.11%	0.34%	8.15%	0.08%	0.96%	0.26%
2016.1.1-2016.3.31	0.79%	0.05%	1.14%	0.07%	-0.35%	-0.02%
2011.5.23-2016.3.31	60.95%	0.28%	29.30%	0.09%	31.65%	0.19%

2、自基金合同生效以来富国天盈债券型证券投资基金(LOF)累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：截止日期为2016年3月31日。

本基金合同生效日为2011年5月23日，本基金建仓期6个月，即从2011年5月23日起至2011年11月22日。建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

十六、费用概览

一、与基金运作有关的费用

(一)与基金运作有关费用列示

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0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.7%÷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、公休假或不可抗力等，顺延至法定节假日、公休日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

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0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.2%÷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、公休日或不可抗力等，顺延至法定节假日、公休日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

3、基金销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.35%年费率计提。基金销售服务费费的计算方法如下：

H=E×0.35%÷当年天数

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金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基金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划出，由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，顺延至法定节假日、公休日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

上述"一、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。

二、与基金销售有关的费用

(一)《基金合同》生效之日起3年内基金的申购与赎回费用

1、天盈A的申购与赎回费用

(1)天盈A不收取申购费用。赎回费用由基金赎回人承担。

(2)、投资者可将其持有的全部或部分天盈A份额赎回。天盈A的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，赎回费归入基金财产的比例为赎回费总额的100%。

(3)天盈A的赎回费率

以《基金合同》生效后每满6个月为天盈A的一个开放周期，持有期限为一个开放周期的，天盈A的赎回费率为0.1%；持有期限为一个以上开放周期(不含)的，天盈A的赎回费为0。

(4)基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在指定媒体公告。

2、天盈B的申购与赎回费用

本基金《基金合同》生效之日起3年内，天盈B封闭运作并上市交易，封闭期内不接受申购与赎回。

天盈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。

(二)《基金合同》生效后3年期届满并进行基金转换后的申购与赎回费用

1、本基金不收取申购费用。赎回费用由基金赎回人承担。

2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的25%。

3、本基金的场外赎回费率如下表所示，本基金的场内赎回费率为固定0.1%：

持有时间	赎回费率
30天以内(含)	0.1%
30天以上	0

4、本基金由原有天盈A、天盈B份额转入的场外份额不收取赎回费；由原有天盈A、天盈B份额转入的场内份额赎回费率为0.1%。

5、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在指定媒体公告。

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，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、费用调整

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、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2日在指定媒体上公告。

五、基金税收

本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。

十七、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、"重要提示"更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2、"三、基金管理人"部分对基金管理人概况、主要人员情况等内容进行了更新。
3、对"四、基金托管人"部分进行了更新。
4、"五、相关服务机构"部分对直销机构、代销机构部分信息进行了更新。
5、"十三、基金的投资"部分对投资组合报告内容更新至2016年3月31日。
6、"十四、基金的业绩"部分对基金业绩更新至2016年3月31日，并更新了历史走势对比图。
7、"二十五、基金份额持有人服务"部分对主要服务内容进行了更新。
8、"二十六、其它应披露事项"部分对本报告期内的应披露事项予以更新。

富国基金管理有限公司
二〇一六年六月十四日

证券代码:600127 证券简称:金健米业 公告编号:2016-28号

金健米业股份有限公司2016年第二次临时股东大会决议公告

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：

●本次会议是否有否决议案：无

一、会议召开和出席情况

(一)股东大会召开的时间：2016年6月13日

(二)股东大会召开的地点：金健米业股份有限公司总部(湖南常德德山开发区崇德路158号)五楼多媒体会议室

(三)出席会议的普通股股东及其持有股份情况：

1、出席会议的股东和代理人人数	12
2、出席会议的股东所持有表决权的股份总数(股)	183,409,152
3、出席会议的股东所持有表决权股份数占公司有表决权股份总数的比例(%)	28.58

(四)表决方式是否符合《公司法》及《公司章程》的规定，大会主持情况等。

本次股东大会由董事会召集，董事长谢文辉先生因公出差委托副董事长陈根荣先生主持会议，会议采取现场投票与网络投票相结合的表决方式，本次会议的召集、召开和表决方式符合《公司法》、《上海证券交易所上市公司股东大会网络投票实施细则(2015年修订)》和《公司章程》的有关规定。

(五)公司董事、监事和董事会秘书的出席情况

1、公司在任董事7人，出席5人，董事谢文辉先生、杨永圣先生因公出差未出席本次会议；

2、公司在任监事3人，出席3人；

3、董事会秘书陈绍红先生出席本次会议，公司其他高级管理人员列席本次会议。

二、议案审议情况

(一)非累积投票议案

议案名称：关于合资设立金健米业(重庆)有限公司(暂定名)的议案

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
A股	182,777,452	99.66	631,700	0.34	0	0.00

(二)涉及重大事项，5%以下股东的表决情况

议案序号	议案名称	同意		反对		弃权	
		票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
1	关于合资设立金健米业(重庆)有限公司(暂定名)的议案	39,427,401	98.42	631,700	1.58	0	0.00

(三)关于议案表决的有关情况说明

本次股东大会审议的议案为普通议案，获得了出席股东大会的股东或股东代理人所持有效表决权的二分之一以上通过。

三、律师见证情况

1、本次股东大会鉴证的律师事务所：湖南启元律师事务所

律师：刘佩、廖青云

2、律师鉴证结论意见：

本次股东大会的召集和召开程序、召集人和出席人员的资格、表决程序和表决结果符合《公司法》、《股东大会规则》及《公司章程》的相关规定，合法、有效。

四、备查文件目录

1、经与会董事和记录人签字确认并加盖董事会印章的股东大会决议；

2、经鉴证的律师事务所主任签字并加盖公章的法律意见书。

金健米业股份有限公司
2016年6月13日

证券代码:600157 证券简称:永泰能源 公告编号:临2016-077
债券代码:122111、122215、122222、122267、136351
债券简称:11永泰债、12永泰01、12永泰02、13永泰债、16永泰01

永泰能源股份有限公司2016年第五次临时股东大会决议公告

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：

●本次会议是否有否决议案：无

一、会议召开和出席情况

(一)股东大会召开的时间：2016年6月13日

(二)股东大会召开的地点：山西省太原市小店区亲贤北街9号双喜广场27层公司会议室

(三)出席会议的普通股股东和恢复表决权的优先股股东及其持有股份情况：

1、出席会议的股东和代理人人数	10
2、出席会议的股东所持有表决权的股份总数(股)	5,306,143,625
3、出席会议的股东所持有表决权股份数占公司有表决权股份总数的比例(%)	42.70

(四)表决方式是否符合《公司法》及《公司章程》的规定，大会主持情况等。

本次股东大会采取现场记名投票和网络投票相结合的表决方式，现场会议由公司董事长徐培忠先生主持，会议的召集、召开及表决方式符合《公司法》及《公司章程》的有关规定。

(五)公司董事、监事和董事会秘书的出席情况

1、公司在任董事8人，出席8人；

2、公司在任监事3人，出席3人；

3、董事会秘书李军先生出席本次会议；其他高级管理人员列席了本次会议。

二、议案审议情况

(一) 非累积投票议案

1、议案名称：关于对募集资金偿还公司和子公司债务进行部分调整的议案

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
A股	5,305,827,225	99.9940	316,400	0.0060	0	0

2、议案名称：关于华兴电力股份公司为公司提供担保的议案

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
A股	5,305,821,025	99.9939	322,600	0.0061	0	0

3、议案名称：关于公司为华熙矿业有限公司提供担保的议案

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
A股	5,305,721,925	99.9921	421,700	0.0079	0	0

4、议案名称：关于公司为郑州裕中能源有限责任公司提供担保的议案

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
A股	5,305,721,925	99.9921	421,700	0.0079	0	0

5、议案名称：关于公司为山西灵石银源兴庆煤业有限公司提供担保的议案

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
A股	5,305,721,925	99.9921	421,700	0.0079	0	0

(二) 关于议案表决的有关情况说明

本次股东大会第2项至第5项议案为特别议案，上述议案获得有效表决权股份总数的2/3以上审议通过。

三、律师见证情况

1、本次股东大会鉴证的律师事务所：上海市锦天城律师事务所

律师：方晓杰律师、谢静律师

2、律师鉴证结论意见：

公司2016年第五次临时股东大会的召集和召开程序、召集人资格、出席会议人员资格、会议表决程序及表决结果等事宜，均符合《公司法》、《上市公司股东大会规则》、《上海证券交易所上市公司股东大会网络投票实施细则(2015年修订)》等法律、法规、规章和其他规范性文件及《公司章程》的有关规定，本次股东大会通过的决议均合法有效。

四、备查文件目录

1、经与会董事和记录人签字确认并加盖董事会印章的股东大会决议；

2、经鉴证的律师事务所主任签字并加盖公章的法律意见书；

3、本所要求的其他文件。

永泰能源股份有限公司
2016年6月14日

股票代码：002377 股票简称：国创高新 公告编号：2016-33号

湖北国创高新材料股份有限公司
关于股东股权解除质押的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

湖北国创高新材料股份有限公司(以下简称"国创高新"、"公司")于2016年6月13日收到股东湖北长兴物资有限公司(以下简称"长兴物资")发来的《关于股权解除质押的通知》，现将有关事项公告如下：

长兴物资于2016年6月7日将其质押给长江证券(上海)资产管理有限公司的2400万股国创高新无限售流通股解除质押，并在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理了相关解除质押登记手续。

截至本公告披露日，长兴物资共持有公司股份2400万股，占公司总股本的5.48%。截至本公告披露日，长兴物资所持公司股份已全部解除质押。

特此公告。

湖北国创高新材料股份有限公司董事会
二〇一六年六月十三日

证券代码：002408 证券简称：齐翔腾达 公告编号：2016-025

淄博齐翔腾达化工股份有限公司
关于参加山东辖区上市公司2016年度投资者网上集体接待日活动的提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

为进一步加强淄博齐翔腾达化工股份有限公司(以下简称"公司")与投资者尤其是中小投资者之间的沟通交流，提升公司投资者关系管理水平，保护投资者权益，公司将于2016年6月16日(星期四)下午14:30-16:30参加由山东证监局举办的"山东辖区上市公司2016年投资者网上集体接待日活动"，现将有关事项公告如下：

本次投资者网上集体接待日活动将在深圳市全景网络有限公司提供的网上平台采取网络远程方式举行，投资者可以登录全景网(www.p5w.net)参与本次活动。

出席本次活动的公司人员有：董事会秘书周洪秀先生、财务总监黄磊女士、证券事务代表姜能成先生。

欢迎广大投资者积极参与。

特此公告。

淄博齐翔腾达化工股份有限公司董事会
2016年6月14日

证券代码：600426 证券简称：华鲁恒升 编号：临2016-015

山东华鲁恒升化工股份有限公司
关于参加山东辖区上市公司2016年投资者网上集体接待日活动的公告

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。

为加强与广大投资者尤其是中小投资者的沟通与交流，提高公司的透明度，进一步提升公司投资者关系管理水平，山东华鲁恒升化工股份有限公司将于2016年6月16日(星期四)下午14:30-16:30参加由山东省证监局举办的"山东辖区上市公司2016年投资者网上集体接待日活动"，现将有关事项公告如下：

一、本次投资者网上集体接待日活动将在深圳市全景网络有限公司提供的网上平台采取网络远程的方式举行，投资者可以登录全景网(www.p5w.net)参与交流。

二、活动时间为2016年6月16日(星期四)14:30-16:30，公司回答投资者问题的时间为15:00-16:20；

三、出席本次投资者网上集体接待日的公司人员有公司董事、副总经理、财务负责人高景宏先生，董事会秘书高文军先生，欢迎广大投资者积极参与。

特此公告。

山东华鲁恒升化工股份有限公司董事会
2016年6月14日