（上接B109版）

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：400-166-1188
联系人：张燕
客户服务热线：400-166-1188
网址：http://8.jrj.com.cn
90）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/
91）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
92）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
（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销售机构，并及时公告。
（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：上海市通力律师事务所
住所：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）31358666
传真：（021）31358600
经办律师：吕红、黎明
联系人：黎明
（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、周玮
联系人：周玮

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5年内，本基金的基金份额划分为添利 A、添利 B两级份额，所募集的基金资产合并运作。
1、基金份额配比
添利A、添利B的份额配比原则上不超过2∶1。
本基金募集设立时，添利A、添利B的份额配比将不超过2∶1。
本基金《基金合同》生效之日起5年内，添利A自《基金合同》生效之日起每满3个月开放一次，添利B封闭运作并上市交易。在添利A的每次开放日，基金管理人将对添利A进行基金份额折算，添利A的基金份额净值调整为1.000元，基金份额持有人持有的添利A份额数按折算比例相应增减。为此，在添利A的单个开放日，如果添利A没有赎回或者净赎回份额极小，添利A、添利B在该次开放日后的份额配比可能会出现大于2∶1的情形；如果添利A的净赎回份额较多，添利A、添利B在该次开放日后的份额配比可能会出现小于2∶1的情形。
2、添利A的运作
（1）收益率
添利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：
添利A的年收益率（单利）=1.3×1年期银行定期存款利率
添利A的年收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后第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添利A的首次年收益率；在添利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添利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2.50%，则添利A的年收益率（单利）为：
添利A的年收益率（单利）=1.3×2.50%=3.25%
（2）开放日
添利A在《基金合同》生效后每满3个月开放一次，接受投资者的申购与赎回。
添利A的开放日为自《基金合同》生效之日起每满3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。
添利A的第一次开放日为《基金合同》生效日至3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；以此类推。如，本基金基金合同已于2010年12月3日生效，基金合同生效之日起满3个月、满6个月、满9个月的日期分别为2011年3月2日、2011年6月2日、2011年9月2日，以此类推。假设2011年3月2日为非工作日，在其之前的最后一个工作日为2011年3月1日，则第一次开放日为2011年3月1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3个月的最后一个工作日，基金管理人将对添利A进行基金份额折算，添利A的基金份额净值调整为1.000元，基金份额持有人持有的添利A份额数按折算比例相应增减。
添利A的基金份额折算基准日与开放日为同一个工作日。
添利A的基金份额折算具体见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5年内，添利A的份额余额原则上不得超过2倍添利B的份额余额。具体规模限制及其控制措施见本《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、添利B的运作
（1）添利B封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回。
添利B的封闭期为自《基金合同》生效之日起至5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，添利B将申请在深圳证券交易所上市交易，本基金的添利B份额已于2010年12月20日在深圳证券交易所上市交易。
（3）本基金在扣除添利A的应计收益后的全部剩余收益归添利B享有，亏损以添利B的资产净值为限由添利B承担。
4、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5年内，T日基金份额的余额数量为添利A和添利B的份额总额；本基金《基金合同》生效后5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。
5、添利A和添利B的基金份额净值计算
本基金《基金合同》生效后，在添利A的开放日计算添利A的基金份额净值；在添利B的封闭期届满日分别计算添利A和添利B的基金份额净值。
（1）添利A的基金份额净值计算

[illegible]

添利A、添利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5年期届满日，设自添利A上一次开放日起的运作天数为90天，基金运作当年的实际天数为365天，基金资产净值为42亿元，添利A、添利B的份额余额分别为20亿份和10亿份，添利A上一次开放日设定的添利A年收益率为3.25%。则添利A、添利B的基金份额净值计算如下：

[illegible]

6、添利A和添利B的基金份额参考净值计算

[illegible]

添利A、添利B的基金份额参考净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。
T日的添利A和添利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《基金合同》生效之日起5年内，设自添利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，添利A、添利B的份额余额分别为20亿份和10亿份，添利A上一次开放日设定的添利A年收益率为3.25%。则添利A、添利B的基金份额参考净值计算如下：

[illegible]

（二）《基金合同》生效后5年期届满时的基金份额转换
本基金《基金合同》生效后5年期届满，在本基金的转换基准日（2015年12月3日），添利A、添利B的基金份额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，自2015年12月4日起，本基金名称变更为天弘添利债券型证券投资基金（LOF）。
本基金《基金合同》生效后5年期届满时的基金转换见本招募说明书第十二部分及基金管理人已发布的相关临时公告。

五、基金的名称

本基金的名称：天弘添利分级债券型证券投资基金。
自2015年12月4日起，本基金名称变更为：天弘添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、添利A的基金份额折算

本基金《基金合同》生效之日起5年内，添利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5年内，添利A的基金份额折算基准日为自《基金合同》生效之日起每满3个月的最后一个工作日。
添利A的基金份额折算基准日与其开放日为同一个工作日。（二）折算对象
基金份额折算基准日登记在册的添利A所有份额。
（三）折算频率
自《基金合同》生效之日起每满3个月折算一次。
（四）折算方式
折算日日终，添利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添利A的份额数按照折算比例相应增减。
添利A的基金份额折算公式如下：
添利A的折算比例＝折算日折算前添利A的基金份额净值／1.000
添利A经折算后的份额数＝折算前添利A的份额数×添利A的折算比例
添利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，折算日折算前添利A的基金份额净值、添利A的折算比例的具体计算见基金管理人发布的相关公告。
添利A已于2015年12月2日进行最后一次折算，折算后本基金已于2015年12月3日完成运作方式的转换并更名为“天弘添利债券型证券投资基金（LOF）”。
（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，暂停添利B的上市交易等业务，具体详见基金管理人发布的相关公告。
由于2015年12月2日添利A的开放日的次一个工作日为本基金的份额转换基准日，添利B已于该日终止上市，终止上市的相关信息详见基金管理人2015 年11 月30日披露的《天弘添利分级债券型证券投资基金之添利B终止上市的公告》。
（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日在指定媒介公告。
2、基金份额折算结束后，基金管理人应在2日内在指定媒介公告。

八、基金份额的上市交易

（一）上市交易的基金份额
本基金《基金合同》生效后5年内，在添利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，添利B的基金份额将申请在深圳证券交易所上市交易。添利B上市后，登记在证券登记结算系统中的添利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添利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《基金合同》生效后5年期届满，本基金按照《基金合同》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
添利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《基金合同》生效后5年期届满，本基金按照《基金合同》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。
添利B基金份额于2010年12月20日在深圳证券交易所上市交易并于2015年12月3日终止上市。本基金完成基金转型后，天弘添利债券型证券投资基金（LOF）于2015年12月15日在深交所上市交易。
（四）上市交易的规则
1、添利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《基金合同》生效之日起5年内，指添利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《基金合同》生效之日起5年内，指添利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《基金合同》生效之日起5年内，为添利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《基金合同》生效之日起5年内，指添利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5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“天弘添利债券型证券投资基金（LOF）”。添利A、添利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）基金转型时添利A的处理方式
本基金《基金合同》生效后5年期届满日前最后一个赎回开放日，基金份额持有人可选择将其持有的添利A份额赎回、或是转入“天弘添利债券型证券投资基金（LOF）”。投资者不选择的，其持有的添利A份额将被默认为转入“天弘添利债券型证券投资基金（LOF）”份额。
本基金《基金合同》生效后5年期届满日为自《基金合同》生效之日后5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5年期届满日与添利B的封闭期届满日相同。
本基金《基金合同》生效后5年期届满日前最后一个赎回开放日，基金管理人将提前公告并提示添利A的基金份额持有人作出选择申请，添利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5年期届满日，即本基金基金合同生效之日起5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，添利A、添利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：
添利A份额（或添利B份额）的转换比率＝份额转换基准日添利A（或添利B）的基金份额净值/1.000
添利A（或添利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添利A（或添利B）的份额数×添利A份额（或添利B份额）的转换比率
在进行份额转换时，添利A、添利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；添利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，添利A份额（或添利B份额）的转换比率、添利A（或添利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
添利A、添利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《基金合同》生效后5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5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）添利A、添利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《基金合同》生效后5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。

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金融工具，主要投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、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、银行存款等固定收益证券品种。
本基金也可投资于非债券类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股与增发新股的申购，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债券类品种。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90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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。
本基金对债券等固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的80%，其中，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%。本基金对非债券类资产的投资比例不超过基金资产的20%。
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

本基金通过对宏观经济增长、通货膨胀、利率走势和货币政策四个方面的分析和预测，确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响。基于各类券种对利率、通胀的反应，制定有效的投资策略，在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上，主动构建及调整固定收益投资组合，力争获取超额收益。此外，通过对首次发行和增发公司内在价值和一级市场申购收益率的全面分析，积极参与新股申购，获得较为安全的新股申购收益。
1、资产配置策略
本基金采取稳健的投资策略，通过固定收益类金融工具的主动投资管理，力求降低基金净值波动风险，并根据股票市场的趋势研判及新股申购收益率预测，积极参与风险较低的一级市场新股和增发新股的申购，力求提高基金收益率。
2、债券投资策略
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，综合运用类属资产配置策略、收益率曲线策略、久期策略、套利策略、个券选择策略等，力求规避风险并实现基金资产的保值增值。
（1）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。
（2）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。
（3）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。
（4）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。
（5）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。
3、新股申购策略
本基金将在审慎原则下参与一级市场新股与增发新股的申购。通过研究首次发行股票及增发新股的上市公司基本面因素，分析新股内在价值、市场溢价率、中签率和申购机会成本等综合评估申购收益率，从而制定相应的申购策略以及择时卖出策略。

十三、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中国债券总指数。
本基金为债券型基金，主要投资于各类固定收益类金融工具，强调基金资产的稳定增值，为此，本基金选取中国债券总指数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，本基金可以在报中国证监会备案后变更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（基金合同）生效之日起5年内，本基金经过基金份额分级后，添利A为低风险、收益相对稳定的基金份额；添利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2016年6月27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

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	1,929,461,292.31	97.35
	其中：债券	1,929,461,292.31	97.35
	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	6,095,033.85	0.31
8	其他各项资产	46,326,724.74	2.34
9	合计	1,981,883,050.90	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、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
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

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	100,108,000.00	5.21
	其中：政策性金融债	100,108,000.00	5.21
4	企业债券	1,326,393,685.81	69.09
5	企业短期融资券	490,262,000.00	25.54
6	中期票据	-	-
7	可转债	12,697,606.50	0.66
8	其他	-	-
9	合计	1,929,461,292.31	100.50

注：可转债项下包含可交换债3,966,877.60元。
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

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	1480460	14十堰城投债	1,000,000	109,580,000.00	5.71
2	1480466	14郧交投债	1,000,000	108,990,000.00	5.68
3	122844	11凯城投	1,000,000	104,050,000.00	5.42
4	1480453	14龙海债	800,000	87,136,000.00	4.54
5	122882	10宁高新	800,010	82,233,027.90	4.28

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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）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。
（3）其他资产构成

序号	名 称	金 额（元）
1	存出保证金	68,753.12
2	应收证券清算款	7,795,722.97
3	应收股利	-
4	应收利息	35,755,241.24
5	应收申购款	2,707,007.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,326,724.74

（4）本基金本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	6,009,915.60	0.31
2	110031	航信转债	753,072.00	0.04

（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
本基金本报告期末未持有股票。
（6）投资组合报告附注的其他文字表述部分
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2010年12月3日，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

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
2010/12/03-2010/12/31	0.30%	0.06%	0.14%	0.09%	0.16%	-0.03%
2011/01/01-2011/12/31	2.27%	0.10%	2.52%	0.11%	-0.25%	-0.01%
2012/01/01-2012/12/31	10.15%	0.12%	-0.66%	0.07%	10.81%	0.05%
2013/01/01-2013/12/31	3.57%	0.18%	-5.29%	0.11%	8.86%	0.07%
2014/01/01-2014/12/31	15.95%	0.22%	7.48%	0.15%	8.47%	0.07%
2015/01/01-2015/12/03	12.75%	0.12%	3.03%	0.12%	9.72%	0.00%
自基金合同生效日（2010/12/03-2015/12/03）	52.99%	0.15%	6.96%	0.11%	46.03%	0.04%
自基金合同转换日（2015/12/04-2015/12/31）	0.90%	0.06%	1.43%	0.09%	-0.53%	-0.03%
2016/01/01-2016/03/31	1.29%	0.06%	0.27%	0.10%	1.02%	-0.04%
自基金合同转换日（2015/12/04-2016/03/31）	2.20%	0.06%	1.71%	0.10%	0.49%	-0.04%

注：本基金合同于2010年12月3日生效，于2015年12月3日5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×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×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、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、公休假等，支付日期顺延。
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。
（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日在至少一种指定媒体上公告。
（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。

十八、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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2016年1月15日公告的《天弘添利分级债券型证券投资基金招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：
1、在“三、基金管理人”部分，根据公司的基本情况及公司人员的变动情况，对基金经理的基本情况及信息、投资决策委员会成员的姓名和职务进行了更新；
2、在“四、基金托管人”部分，根据基金托管人提供的内容做了相应的更新；
3、在“五、相关服务机构”部分，更新了销售机构相关信息；
4、在“十、基金份额的申购与赎回”部分，更新了本基金转型的相关信息；
5、在“十一、基金份额的上市交易”部分，更新了转型后本基金上市的相关信息；
6、在“十五、基金投资组合报告”部分，按有关规定补充了本基金近一期投资组合报告的内容；
7、在“十六、基金的业绩”部分，更新了基金业绩数据，并经基金托管人复核；
8、在“二十八、其他应披露的事项”部分，对本次更新内容期间的相关公告进行了更新。

天弘基金管理有限公司
二〇一六年七月十五日

证券代码：002065　证券简称：东华软件　公告编号：2016-065

东华软件股份公司关于筹划发行股份购买资产事项的进展公告

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。

东华软件股份公司（以下称"公司"）于2016年6月16日召开第五届董事会第三十八次会议，审议并通过了《东华软件股份公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金预案》等相关议案，详情参见2016年6月17日刊登在《中国证券报》、《证券日报》、《证券时报》及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）上的相关公告。
2016年6月28日，公司收到深圳证券交易所《关于对东华软件股份公司的重组问询函》（中小板重组问询函（需行政许可）【2016】第59号），公司已于2016年7月1日就问询函所涉及的相关问题回复，对预案进行了相应的修订、补充和完善。公司第五届董事会第三十九次会议审议并通过了《关于修改公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金方案的议案》等相关议案，详情参见2016年7月1日刊登在《中国证券报》、《证券日报》、《证券时报》及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）上的相关公告。经深圳证券交易所审核通过后，公司股票（股票简称：东华软件；股票代码：002065）自2016年7月4日开市起复牌。现根据相关规定就本次重大资产重组最新进展情况公告如下：
一、本次重大资产重组进展情况
目前，公司及聘请的中介机构正在积极顺利地推进本次重大资产重组相关事项的后续工作，审计机构和评估机构正积极推进对本次重大资产重组涉及的标的资产的审计和评估；独立财务顾问和律师正在继续进行相关申报材料的制作工作；待上述相关工作完成后，公司将再次召开董事会会议审议本次重大资产重组的相关事项，同时披露《东华软件股份公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金草案》，待董事会审议通过后，公司将及时发出召开审议本次重大资产重组事项的股东大会通知，并按相关法律法规的规定，履行有关审批程序。
二、特别提示
1、公司于2016年7月1日披露的《东华软件股份公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金预案（修订稿）》中"重大风险提示"章节中，详细披露了本次重大资产重组可能涉及的有关重大风险因素及尚需履行的审批程序，敬请投资者认真阅读有关内容，并注意投资风险。
2、截至本公告披露之日，公司未发现存在可能导致公司董事会或者交易对方撤销、中止本次重大资产重组方案或者对本次重大资产重组方案做出实质性变更的相关事项，但不排除发生以上事项的可能，敬请广大投资者注意投资风险。
3、根据《上市公司重大资产重组管理办法》及深圳证券交易所《中小企业板信息披露业务备忘录第8号：重大资产重组相关事项（2015年6月11日修订）》的有关规定，公司在发出召开审议本次重大资产重组事项的股东大会通知之前，将每三十日发布一次本次重大资产重组的工作进展公告。
本公司筹划的发行股份购买资产事项尚存较大不确定性，敬请广大投资者关注相关公告并注意投资风险。公司指定披露媒体为《中国证券报》、《证券日报》、《证券时报》及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公司相关信息均以上述指定媒体披露的公告为准。
特此公告。

东华软件股份公司董事会
二零一六年七月十五日

证券代码：002070　证券简称：众和股份　公告编号：2016-060

福建众和股份有限公司2016年半年度业绩预告修正公告

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

一、预计的本期业绩情况
1. 业绩预告期间：2016年1月1日至2016年6月30日
2. 前次业绩预告情况