（上接B90版）

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T_A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，$NV_T$为T日闭市后的基金资产净值，$F_{AT}$为T日同利A的份额余额，$F_A$为T日同利B的份额余额，$NAV_{AT}$为T日同利A的基金份额净值，r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：

[illegible]

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：

[illegible]

（2）同利B的基金份额净值计算

设$NAV_{BT}$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：

[illegible]

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：

[illegible]

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

[illegible]

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：

[illegible]

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：

[illegible]

（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的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。

（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 | 110031 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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① | 份额净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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×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、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×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

# 新疆金风科技股份有限公司

**2017 第三季度报告**　证券代码：002202　证券简称：金风科技　公告编号：2017-045

第一节 重要提示

公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证季度报告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。

所有董事均已出席了审议本次季报的董事会会议。

公司负责人武钢、主管会计工作负责人霍常堂及会计机构负责人(会计主管人员)吕鹏声明：保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

第二节 公司基本情况

一、主要会计数据和财务指标

公司是否需追溯调整或重述以前年度会计数据

☐ 是 √ 否

| | 本报告期末 | | 上年度末 | | 本报告期末比上年度末增减 |
|---|---|---|---|---|---|
| 总资产(元) | 67,825,364,750.81 | | 64,437,164,996.24 | | 5.26% |
| 归属于上市公司股东的净资产(元) | 21,673,905,872.43 | | 19,976,152,035.10 | | 8.50% |
| | 本报告期 | 本报告期比上年同期增减 | 年初至报告期末 | 年初至报告期末比上年同期增减 | |
| 营业收入(元) | 7,167,227,348.80 | 18.58% | 17,006,751,441.72 | | 0.25% |
| 归属于上市公司股东的净利润(元) | 1,163,247,132.74 | 68.44% | 2,296,165,383.59 | | 7.26% |
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润(元) | 1,051,344,807.19 | 70.19% | 2,144,930,486.08 | | 4.76% |
| 经营活动产生的现金流量净额(元) | 527,081,571.75 | -49.04% | -1,024,449,635.17 | | -3.97% |
| 基本每股收益(元/股) | 0.3220 | 65.81% | 0.6307 | | 4.77% |
| 稀释每股收益(元/股) | 0.3220 | 65.81% | 0.6307 | | 4.77% |
| 加权平均净资产收益率 | 5.67% | 1.95% | 11.43% | | -0.58% |

注：本报告期、年初至报告期末与上年同期基本每股收益和稀释每股收益均以参照2017年6月28日召开的股东大会审议通过的2016年度利润分配方案（以2016年末总股本为基数，每10股向全体股东派发股票股利3股）实施后的股数重新计算。

非经常性损益项目和金额

√ 适用 ☐ 不适用

单位：元

| 项目 | 年初至报告期期末金额 | 说明 |
|---|---|---|
| 非流动资产处置损益(包括已计提资产减值准备的冲销部分) | -1,847,817.46 | |
| 越权审批或无正式批准文件的税收返还、减免 | 0.00 | |
| 计入当期损益的政府补助(与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外) | 150,940,167.82 | |
| 计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费 | 0.00 | |
| 企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益 | 0.00 | |
| 非货币性资产交换损益 | 0.00 | |
| 委托他人投资或管理资产的损益 | 0.00 | |
| 因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备 | 0.00 | |
| 债务重组损益 | 0.00 | |
| 企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等 | 0.00 | |
| 交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益 | 0.00 | |
| 同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益 | 0.00 | |
| 与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益 | 0.00 | |
| 除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益 | 42,604,912.03 | |
| 单独进行减值测试的应收款项减值准备转回 | 0.00 | |
| 对外委托贷款取得的损益 | 0.00 | |
| 采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益 | 0.00 | |
| 根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响 | 0.00 | |
| 受托经营取得的托管费收入 | 0.00 | |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出 | -8,274,790.85 | |
| 其他符合非经常性损益定义的损益项目 | 0.00 | |
| 减：所得税影响额 | 32,993,401.52 | |
| 少数股东权益影响额(税后) | -405,827.49 | |
| 合计 | 151,234,897.51 | — |

对公司根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》定义界定的非经常性损益项目，以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因

☐ 适用 √ 不适用

公司报告期不存在将根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》定义、列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目的情形。

二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

1、普通股股东和表决权恢复的优先股股东数量及前10名股东持股情况表

单位：股

| 报告期末普通股股东总数 | | 130,401 | 报告期末表决权恢复的优先股股东总数(如有) | | 0 |
|---|---|---|---|---|---|
| 前10名股东持股情况 | | | | | |
| 股东名称 | 股东性质 | 持股比例 | 持股数量 | 持有有限售条件的股份数量 | 质押或冻结情况 股份状态 | 数量 |
| 香港中央结算(代理人)有限公司 | 境外法人 | 18.23% | 648,357,465 | | | |
| 新疆风能有限责任公司 | 国有法人 | 13.74% | 488,696,502 | | 质押 | 97,011,200 |
| 中国三峡新能源有限公司 | 国有法人 | 10.52% | 373,957,073 | | | |
| 安邦人寿保险股份有限公司-保守型投资组合 | 其他 | 7.84% | 278,904,260 | | | |
| 和谐健康保险股份有限公司-万能产品 | 其他 | 4.14% | 147,222,544 | | | |
| 全国社保基金一一三组合 | 其他 | 2.18% | 77,678,541 | | | |
| 中央汇金资产管理有限责任公司 | 国有法人 | 1.68% | 59,877,610 | | | |
| 武钢 | 境内自然人 | 1.47% | 52,217,152 | 39,162,864 | | |
| 安邦养老保险股份有限公司-团体万能产品 | 其他 | 0.87% | 31,109,165 | | | |
| 海通证券资管-招商证券-海通金风2号集合资产管理计划 | 其他 | 0.72% | 25,431,900 | 25,431,900 | | |
| 前10名无限售条件股东持股情况 | | | | | | |
| 股东名称 | 持有无限售条件股份数量 | | | 股份种类 股份种类 | 数量 | |
| 香港中央结算(代理人)有限公司 | 648,357,465 | | | 境外上市外资股 | 648,357,465 | |
| 新疆风能有限责任公司 | 488,696,502 | | | 人民币普通股 | 488,696,502 | |
| 中国三峡新能源有限公司 | 373,957,073 | | | 人民币普通股 | 373,957,073 | |
| 安邦人寿保险股份有限公司-保守型投资组合 | 278,904,260 | | | 人民币普通股 | 278,904,260 | |
| 和谐健康保险股份有限公司-万能产品 | 147,222,544 | | | 人民币普通股 | 147,222,544 | |
| 全国社保基金一一三组合 | 77,678,541 | | | 人民币普通股 | 77,678,541 | |
| 中央汇金资产管理有限责任公司 | 59,877,610 | | | 人民币普通股 | 59,877,610 | |
| 安邦养老保险股份有限公司-团体万能产品 | 31,109,165 | | | 人民币普通股 | 31,109,165 | |
| 王利明 | 24,505