

富国天丰强化收益债券型证券投资基金 上市交易公告书

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

登记结算机构：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：2008年12月8日

公告时间：2008年12月3日

目录

一、重要声明与提示	2
二、基金概况	2
三、基金的募集和上市交易	3
四、持有人户数、持有人结构和前十名持有人	5
五、基金主要当事人简介	6
六、基金合同摘要	12
七、基金财务状况	36
八、基金投资组合	37
九、重大事件揭示	39
十、基金管理人承诺	39
十一、基金托管人承诺	40
十二、备查文件目录	40

一、重要声明与提示

富国天丰强化收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书根据《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交易规则》等规定编制。本基金管理人的董事会和董事保证本报告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。

本基金托管人保证本报告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、深圳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。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2008 年 10 月 10 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及富国基金管理有限公司网站（www.fullgoal.com.cn）上的《富国天丰强化收益债券型证券投资基金招募说明书》。

二、基金概况

- 1、基金简称：富国天丰
- 2、交易代码：161010
- 3、基金份额总额：1,998,141,990.50 份
- 4、基金份额净值：1.018 元（截至 2008 年 11 月 30 日）
- 5、本次上市交易份额：375,612,910.00 份
- 6、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 7、上市交易日期：2008 年 12 月 8 日
- 8、基金管理人：富国基金管理有限公司
- 9、基金托管人：中国建设银行股份有限公司
- 10、上市推荐人：无

三、基金的募集和上市交易

(一) 本基金上市前募集情况

1、基金募集的核准机构和核准文号：中国证监会 2008 年 9 月 5 日证监许可 [2008]1105 号。

2、基金运作方式：契约型，本基金合同生效后三年内封闭运作，在交易所上市交易，基金合同生效满三年后转为上市开放式。

3、基金募集时间：2008 年 10 月 15 日至 2008 年 10 月 17 日

4、发售价格：1.00 元人民币

5、发售方式：场内和场外发售

6、发售机构

(1) 场内发售机构

本基金场内发售的机构为具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。

(2) 场外发售机构

本基金场外发售的机构包括本公司的直销中心和中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行、宁波银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、深圳平安银行股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国海证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、国联证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、中信金通证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、东北证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、恒泰证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、齐鲁证券经

纪有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司。

8、验资机构名称：安永华明会计师事务所。

9、募集资金总额及入账情况

本基金最终募集的有效认购户数为 5,016 户，净销售额为人民币 1,997,741,014.10 元，折合基金份额 1,997,741,014.10 份；募集资金在基金合同生效前产生的利息共计 400,976.40 人民币元，折合 400,976.40 份基金份额归基金份额持有人所有。在基金募集期内，富国基金管理有限公司的基金从业人员未认购富国天丰债券基金；富国基金管理有限公司使用自有资金认购富国天丰债券基金份额 13,570,221.30 份，占基金份额总量的 0.68%。上述资金已于 2008 年 10 月 23 日划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的富国天丰强化收益债券型证券投资基金托管专户。

10、基金备案情况

本基金于 2008 年 10 月 23 日验资完毕，并于次日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续。2008 年 10 月 24 日中国证监会基金部函[2008]456 号文予以书面确认，《富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金合同》自该日起生效。

11、基金合同生效日：2008 年 10 月 24 日

12、基金合同生效日的基金份额总额：1,998,141,990.50 份

（二）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【2008】160 号

2、上市交易日期：2008 年 12 月 8 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称：富国天丰

5、交易代码：161010

6、本次上市交易份额：375,612,910.00 份

7、基金资产净值的披露

本基金上市交易后，基金管理人每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传送给深圳证券交易所，深圳证券交易所于次日通过行情系统揭示。根据《基金法》，本基金的基金会计责任方为基金管理人，因此基金管理人对公布的基金份额净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在基金场外发售机构，持有人将其转托管至深圳证券交易所场内发售机构后即可上市流通。

本基金场内发售机构为具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位；本基金场外发售的机构包括本公司的直销中心和中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行、宁波银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、深圳平安银行股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国海证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、国联证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、中信金通证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、东北证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、恒泰证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、齐鲁证券经纪有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司。

四、持有人户数、持有人结构和前十名持有人

截至 2008 年 11 月 30 日的场内基金份额持有情况如下：

1、场内基金份额持有人户数为 1083 户；平均每户持有场内基金份额 346,826.33 份。

2、场内机构持有人持有基金份额 250,730,714.00 份，占场内基金份额总数的 66.75%；场内个人持有人持有基金份额 124,882,196.00 份，占场内基金份额总数的 33.25%。

3、场内前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	证券账户号	持有基金份额	占场内基金份额的比例（%）
1	中信信托有限责任公司-嘉实奖励	0506938065	67,797,300.00	18.05%
2	上海汽车集团财务有限责任公司	0800009601	50,006,000.00	13.31%
3	招商证券股份有限公司	0899038828	50,006,000.00	13.31%
4	太原市自来水公司	0800007313	30,003,600.00	7.99%
5	中海-丰赢 1 号	0506938022	20,004,400.00	5.33%
6	上海远东证券有限公司	0503261207	17,700,593.00	4.71%
7	中信信托有限责任公司-中联油	0506938056	10,001,700.00	2.66%
8	叶继春	0102774336	10,000,350.00	2.66%
9	邵壁盛	0000314517	5,000,700.00	1.33%
10	魏东	0052104338	5,000,700.00	1.33%
合计			265,521,343.00	70.69%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人概况

1、基本情况

名称：富国基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

设立日期：1999 年 4 月 13 日

批准设立机关和批准设立文号：证监基字【1999】11 号

法定代表人：陈敏

总经理：陈敏（代）

联系人：李长伟

电话：(021) 68597788

法人营业执照文号：310000400214240

注册资本：人民币 1.8 亿元

存续期间：持续经营

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

2、股权结构（截止于 2008 年 11 月 30 日）：

股东名称	出资比例（%）
海通证券股份有限公司	27.775
申银万国证券股份有限公司	27.775
加拿大蒙特利尔银行	27.775
山东省国际信托投资公司	16.675

3、内部组织机构及职能

富国基金管理有限公司经中国证监会证监基字【1999】11 号文批准，于 1999 年 4 月 13 日成立，是中国第一批基金管理公司之一。

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策。风险控制委员会负责对基金投资的风险评估和防范，进行重点风险监督、控制与管理，就基金投资制定控制公司内部风险的政策，并在市场发生重大变化的情况下，研究制定风险控制的办法。

公司目前下设十一个部门和两个分公司，分别是：基金管理部、研究策划部、境外投资部、资产管理部、市场与发展部、信息技术部、监察稽核部、计划财务部、基金清算部、人力资源部、行政管理部、北京分公司和深圳分公司。基金管理部负责根据投资决策委员会制定的决策进行基金投资，下设基金经理组和集中交易室，分别负责基金管理和交易指令执行与监督。研究策划部负责行业和上市公司研究。境外投资部主要负责投资海外证券投资基金的投资管理工作。资产管理部负责社保基金以及其他机构投资者的委托投资与客户服务。市场与发展部负责产品研究与设计、基金销售、市场推广、客户服务、销售渠道管理等。信息技术部负责公司信息系统的日常运行与维护，跟踪研究新技术，进行相应的技术系统规划与开发。监察稽核部负责对公司及员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查。计划财务部负责公司计划和战略的拟订、督办以及公司财务。基金清算部负责基金会计核算、估值、开放式基金注册、

登记和清算等业务。人力资源部负责公司人事劳资管理工作。行政管理部负责公司文字档案、后勤服务等综合事务管理。

4、人员情况

截止到 2008 年 11 月 30 日，公司有员工 154 人，其中 57%以上具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

5、信息披露负责人及咨询电话

联系人：李长伟

电话：021-68597788

6、基金管理业务情况简介

截止 2008 年 11 月 30 日，基金管理人管理的基金为基金汉盛、基金汉兴、富国天丰强化收益债券型证券投资基金 3 只封闭式基金，和富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金 10 只开放式基金，管理的基金净资产为 389 亿元。

7、本基金基金经理

饶刚，1973 年出生，硕士研究生，自 1999 年开始从事证券行业工作，曾任兴业证券股份有限公司研究部行业研究、金融创新研究员，兴业证券股份有限公司投资银行部投资银行业务创新、项目策划，富国基金管理公司债券及可转债、金融创新研究员，自 2006 年 1 月开始担任富国天利增长债券基金基金经理，兼任富国基金管理有限公司固定收益部经理。

钟智伦，生于 1968 年，经济学硕士，14 年证券从业经历。历任平安证券部门经理、上海新世纪投资服务有限公司研究员、海通证券投资经理、富国基金管理有限公司债券研究员，自 2006 年 6 月开始担任富国天时货币市场基金基金经理。

（二）基金托管人概况

1、基金托管人基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：HK0939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后建设银行的已发行股份总数为：233,689,084,000 股（包括 224,689,084,000 股 H 股及 9,000,000,000 股 A 股）。2008 年，中国建设银行的综合盈利能力和资产质量继续同业领先，截止 2008 年 6 月 30 日，中国建设银行实现净利润 586.92 亿元，同比增长 71.34%。年化平均资产回报率为 1.72%，年化平均股东权益回报率为 26.36%，分别较上年同期提高 0.54 个百分点和 6.56 个百分点，每股盈利为 0.25 元，同比增长 0.10 元。总资产达到 70,577.06 亿元，较上年末增长 6.96%。资产质量稳步上升，不良贷款额和不良贷款率实现双降，信贷资产质量持续改善，不良贷款率为 2.21%，较上年末下降 0.39 个百分点。拨备水平充分，拨备覆盖率为 117.23%，较上年末提升 12.82 个百分点。

中国建设银行在中国内地设有 1.4 万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行，在伦敦、纽约、悉尼设有代表处。

2006年12月，中国建设银行在香港收购了美国银行在香港的全资子公司美国银行(亚洲)股份有限公司100%的股权，美国银行(亚洲)有限公司更名为“中国建设银行(亚洲)股份有限公司”。

2008年上半年，中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的世界银行500强中列第18位；被美国《福布斯》杂志评为全球上市公司2000强第69位；被英国《金融时报》评为“全球500强”第62位；在英国《金融时报》公布的全球市值500强中列第20位；在美国《财富》杂志全球企业500强排名中列第171位，较上年大幅提升59位；荣获英国《欧洲货币》杂志「最佳房地产投资奖」、香港《资本》杂志「中国杰出零售银行奖」、万事达国际组织「最佳商务卡奖」、「最佳联名卡奖」、「最佳产品设计奖」和香港《财资》杂志「中国最佳托管银行」等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室，现有员工110余人。2008年，中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会(AICPA)颁布的审计准则公告第70号(SAS70)进行的内部控制审计，并被安永会计师事务所评价为“业内最干净的无保留意见的报告”，中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

2、主要人员情况

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

截止到2008年6月30日，中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、通乾、银丰等7只封闭式证券投资基金，以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置3只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华一道琼斯88精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华安上证180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银效率优选、华夏深圳中小企业板ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信精选平衡、鹏华价值优势、中信稳定债券、华安宏利、上投摩根成长先锋、博时价值增长贰号、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚精萃成长、工银瑞信稳健成长、信达澳银领先增长、诺德价值优势、工银瑞信债券、国泰金鼎价值、富国天博、融通领先成长、华宝兴业行业精选、工银瑞信红利、泰达荷银市值优选、长城品牌优选、交银施罗德蓝筹、华夏全球精选、易方达增强回报、南方盛元红利、交银施罗德增利、工银信添利、宝盈资源优选、华安稳定收益、兴业社会责任、华宝兴业海外中国成长、宝盈增强收益、鹏华丰收债券、博时特许价值、华富收益增强、信诚盛世蓝筹、东方策略成长、海富通全球精选中国概念等71只开放式证券投资基金。

(三) 基金上市推荐人的信息

无

(四) 基金验资机构

名称：安永华明会计师事务所

注册地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼

办公地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼

法定代表人：沈钰文

联系电话：(021) 24052000

传真：(021) 54075507

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

六、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

1、基金份额持有人的权利和义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》发售的基金份额，即成为本基金基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为本《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章为必要条件。

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）依法转让及根据基金合同约定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。

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、代销机构、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。

2、基金管理人的权利与义务

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、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(10) 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务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。

3、基金托管人的权利与义务

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，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

- (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

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

1、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，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止基金合同；
- 2) 封闭期内基金的扩募；
- 3) 转换基金运作方式，本基金依据本基金合同的约定直接转换运作方式的除外；
- 4) 变更基金类别；
- 5) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 6) 变更基金份额持有人大会程序；
- 7) 更换基金管理人、基金托管人；

8) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

9) 本基金与其他基金的合并；

10) 终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

11) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

12) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同或其他相关法律文件，不需召开基金份额持有人大会：

1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

5) 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；

6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、会议召集人及召集方式

(1) 除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 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，应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有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。

(4) 代表基金份额 10%以上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,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(5) 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。

3、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) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

- 1)会议召开的时间、地点和出席方式;
- 2)会议拟审议的主要事项;
- 3)会议形式;
- 4)议事程序;
- 5)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;
- 6)代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;
- 7)表决方式;
- 8)会务常设联系人姓名、电话;
- 9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- 10)召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

4、基金份额持有人出席会议的方式

(1) 会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4) 会议的召开方式由召集人确定。

(2) 召开基金份额持有人大会的条件

1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

a. 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上；

b. 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

a. 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

b. 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

c.召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的,不影响表决效力;

d.本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50% 以上;

e.直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与登记结算机构记录相符。

如果开会达不到上述的条件,则召集人有权另行确定并公告重新表决的时间,且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

5、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

1)议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2)基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3)对于基金份额持有人提交的提案,大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4)单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其时间间隔不少于 6 个月。但因出现本基金合同第十八条第(三)款规定之情形应再次召开基金份额持有人大会的,不受该时间间隔限制。法律法规另有规定的除外。

5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后,如果需要对原有提案进行修改,应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

(2) 议事程序

1)现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项,确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的,其授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权代表主持;如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

2)通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下,首先由召集人提前 30 日公布提案,在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机关监督下形成的决议有效。

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

6、表决

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50% 以上通过方为有效,除下列 2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式（本基金依据本基金合同的约定正常转换运作方式的除外）、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

(4) 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

7、计票

(1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点, 由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议, 可以对投票数进行重新清点; 如大会主持人未进行重新清点, 而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议, 其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点, 大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下, 计票方式为: 由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票, 并由公证机关对其计票过程予以公证; 如监督人经通知但拒绝到场监督, 则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票, 并由公证机关对其计票过程予以公证。

8、生效与公告

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议, 召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本章第(二)条所规定的第 1)-10)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行, 关于本章第(二)条所规定的第 11)、12)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

(2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决, 在公告基金份额持有人大会决议时, 必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

9、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的, 从其规定

(三) 基金收益分配原则、执行方式

1、基金收益的构成

- (1) 买卖证券差价;
- (2) 基金投资所得红利、股息、债券利息;

- (3) 银行存款利息；
- (4) 已实现的其他合法收入；
- (5) 持有期间产生的公允价值变动；
- (6) 其他收益。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

2、基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定应在基金收益中扣除的费用后的余额。

3、收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

(1) 封闭期间，基金收益分配采用现金方式；开放期间，基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择获取现金红利或将现金红利按再投日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金红利；登记在深圳证券账户的基金份额只能采取现金红利方式，不能选择红利再投资；

(2) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(3) 本基金收益每年最多分配 12 次，每年基金收益分配比例不低于该年度可分配收益的 90%；

(4) 在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(6) 基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(7) 基金合同生效满 6 个月后，若基金在每月最后一个交易日收盘后每 10 份基金份额可分配收益金额高于 0.05 元(含)，则基金须在 10 个工作日之内进行收益分配，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%；

(8) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(9) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

5、收益分配的时间和程序

(1) 基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

(2) 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

(四) 作为基金管理人、基金托管人报酬的管理费、托管费的提取、支付方式

1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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，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。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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，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托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(五) 与基金财产管理、运作有关的其他费用的提取、支付方式与比例

1. 与基金财产管理、运作有关的其他费用的种类

(1) 基金财产拨划支付的银行费用；

- (2) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- (3) 基金份额持有人大会费用；
- (4) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (5) 基金的证券交易费用；
- (6) 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
- (7) 依法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参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

2. 上述基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(六) 基金财产的投资方向和投资限制

1、投资目标

本基金投资目标是在追求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造较高的当期收益。

2、投资范围

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。

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，但可以参与一级市场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。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。

基金的投资组合比例为：本基金在封闭期间，投资于固定收益类资产的比例为基金资产的 80%—100%，投资于非固定收益类资产的比例为基金资产的 0%—20%；在开放期间，投资于固定收益类资产的比例为基金资产的 80%—95%，投资于非固定收益类资产的比例为基金资产的 0%—20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3、投资限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及基金合同生效后三年内封闭运作，三年后开放的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (6) 本基金在封闭期间，投资于固定收益类资产的比例为基金资产的 80%—100%，投资于非固定收益类资产的比例为基金资产的 0%—20%；在开放期间，投资于固定收益类资产的比例为基金资产的 80%—95%，投资于非固定收益类资产的比例为基金资产的 0%—20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
- (7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (9) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基

金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(12) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(13) 如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制做出变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，可将调整时限从 10 个交易日延长到 3 个月。法律法规如有变更，从其变更。

基金管理人应当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基金合同的有关约定。除投资资产配置比例外，基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

4、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

(9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

（七）基金资产净值的计算方法和公告方式

1、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

（1）股票估值方法：

1) 上市流通股股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

2) 未上市股票的估值：

a. 首次发行未上市的股票，按成本计量；

b. 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

c. 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

d. 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1)－2) 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1)－2) 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（2）固定收益证券的估值方法：

1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，以最近交易日的收盘净价估值；

3) 发行未上市债券采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本进行后续计量;

4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种, 采用估值技术确定公允价值;

5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券所处的市场分别估值;

6) 在任何情况下, 基金管理人如采用本项第 1) —5) 小项规定的方法对基金资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第 1) —5) 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值, 基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值;

7) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

(3) 权证估值方法:

1) 基金持有的权证, 从持有确认日起到卖出日或行权日止, 上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值; 估值日没有交易的, 按最近交易日的收盘价估值;

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值; 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本计量;

2) 在任何情况下, 基金管理人如采用本项第 1) 小项规定的方法对基金资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第 1) 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可根据具体情况, 并与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值;

3) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

(4) 如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时, 应立即通知对方, 共同查明原因, 双方协商解决。

(5) 根据有关法律法规, 基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人

承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

2、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

3、估值程序

(1) 基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

(2) 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

4、基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

(1) 本基金的基金合同生效后，基金上市交易前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

(2) 基金上市交易后，基金管理人将在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露基金份额净值和基金份额累计净值；

(3) 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

(4) 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

(八) 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、《基金合同》的变更

(1) 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应

召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

- 1) 终止基金合同；
- 2) 封闭期内基金的扩募；
- 3) 转换基金运作方式，本基金依据本基金合同的约定直接转换运作方式的除外；
- 4) 变更基金类别；
- 5) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 6) 变更基金份额持有人大会程序；
- 7) 更换基金管理人、基金托管人；
- 8) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- 9) 本基金与其他基金的合并；
- 10) 终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- 11) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 12) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 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；
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(2) 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2

日内在至少一种指定媒体公告。

2、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- (3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- (4) 法律法规、中国证监会规定或基金合同约定的其他情形。

3、基金财产的清算

(1) 基金财产清算组

1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

(2) 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- 7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- 8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；

- 9) 公布基金财产清算结果；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

(3) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

(4) 基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1)－3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

(5) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

(6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(九) 争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

(十) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和

登记结算机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

七、基金财务状况

1、本基金募集期间相关费用明细及节余情况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用。各基金销售机构根据本基金《招募说明书》设定的认购费率收取认购费。

2、本基金发售后至本公告书公告前的重要财务事项。

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。

3、富国天丰强化收益债券型证券投资基金截至 2008 年 11 月 30 日资产负债表如下（除特别注明外，金额单位为人民币元）：

资产	2008-11-30
银行存款	117,993,643.11
结算备付金	8,871,119.58
存出保证金	0.00
交易性金融资产	1,892,862,533.79
其中：股票投资	0.00
债券投资	1,751,861,533.79
资产支持证券投资	141,001,000.00
应收证券清算款	0.00
衍生金融资产	0.00
应收利息	17,533,996.71
资产合计	2,037,261,293.19

负债	2008-11-30
应付证券清算款	2,082,021.12

应付赎回款	0.00
应付管理人报酬	992,375.16
应付托管费	330,791.73
应付交易费用	5,352.50
应交税费	0.00
应付利润	0.00
其他负债	49,992.96
负债合计	3,460,533.47
所有者权益	
实收基金	1,998,141,990.50
未分配利润	35,658,769.22
所有者权益合计	2,033,800,759.72
负债和所有者权益总计	2,037,261,293.19

八、基金投资组合

截止到 2008 年 11 月 30 日，富国天丰强化收益债券型证券投资基金的投资组合如下：

(一) 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	0.00	0.00
	其中：股票	0.00	0.00
2	固定收益投资	1,892,862,533.79	92.91
	其中：债券	1,751,861,533.79	85.99
	资产支持证券	141,001,000.00	6.92
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中： 买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	126,864,762.69	6.23
6	其他资产	17,533,996.71	0.86
7	合计	2,037,261,293.19	100.00

(二) 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资产。

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

本基金本报告期末未持有股票资产。

(四) 报告期末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	0.00	0.00
2	央行票据	97,760,000.00	4.81
3	金融债券	0.00	0.00
	其中:政策性金融债	0.00	0.00
4	企业债券	1,440,072,560.39	70.81
5	企业短期融资券	121,236,000.00	5.96
6	可转债	92,792,973.40	4.56
7	其他	0.00	0.00
8	合计	1,751,861,533.79	86.14

(五) 期末按券种占基金资产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	088054	08南网债01	1,900,000	190,912,000.00	9.39
2	112006	08万科G2	1,399,997	144,045,691.33	7.08
3	0881182	08方正CP02	1,200,000	121,236,000.00	5.96
4	088028	08合肥建投债	1,180,000	121,068,000.00	5.95
5	088037	08闽高速债	1,100,000	114,763,000.00	5.64

(六) 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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0831011	08建元1优先	2,000,000	110,860,000.00	5.45
2	0840011	08浙元1A	300,000	30,141,000.00	1.48

(七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的权证明细

本基金本报告期末未持有权证资产。

(八) 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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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股票资产。

3、其他资产的构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	17,533,996.71
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	17,533,996.71

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、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资产。

6、由于四舍五入的原因，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。

九、重大事件揭示

截至 2008 年 11 月 30 日，本基金暂无其他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、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

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定和约定,设立专门的基金托管部,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。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定和约定,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。

(三)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、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的住所,投资者可在办公时间免费查阅;也可按工本费购买复印件,但应以正本为准。

(一)中国证监会《关于核准富国天丰强化收益债券型证券投资基金募集的批复》;

(二)《富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金合同》;

(三)《富国天丰强化收益债券型证券投资基金招募说明书》;

(四)《富国天丰强化收益债券型证券投资基金托管协议》;

(五)关于富国天丰强化收益债券型证券投资基金募集之法律意见书;

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照;

(八) 中国证监会要求的其他文件。

富国基金管理有限公司

二〇〇八年十二月三日