(上接 C169 版)

联系人：李娟
客服：400-025-6569
网址：wacaijijin.com
(73)中民财富基金销售(上海)有限公司
注册地址：上海黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元
办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层
法定代表人：弭洪军
电话：18521506916
联系人：黄鹏
客服：400-876-5716
网址：www.cmiwm.com
(74)万家财富基金销售(天津)有限公司
注册地址：天津自贸区(中心商务区)迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 5 层
法定代表人：李修辞
电话：13811914597
联系人：杨雪
客服电话：010-59013828
网址：www.wjasset.com
(75)洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司
注册地址：山东省青岛市香港东路 195 号 9 号楼 701 室
办公地址：北京市西城区西什库大街 31 号院九思文创园 5 号楼 501 室
法定代表人：任淑桢
电话：010-66121830
联系人：周映筱
客服电话：0532-66728591
网址：www.hongtaiwealth.com
(76)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 栋 2 楼 268 室
办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层
法定代表人：毛淮平
电话：13810439687
联系人：张静怡
客服电话：400-817-5666
网址：www.amcfortune.com
(77)和耕传承基金销售有限公司
注册地址：郑州市郑东新区东凤东路东、康宁街北 6 号楼 6 楼 602、603 房间
办公地址：北京市朝阳区酒仙桥路 6 号楼国际电子城 b 座
法定代表人：李淑慧
电话：13810222517
联系人：董亚芳
客服电话：400-360-000
网址：www.hgccpb.com
(78)国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号
办公地址：上海市静安区新闸路 669 号博华广场 19 楼
法定代表人：贺青
电话：021-38676767
联系人：朱雅崴
客户服务热线：400-8888-666
网址：www.gtja.com
(79)中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人：王常青
电话：010-85156310
传真：010-65182261
联系人：刘芸
客户服务热线：400-8888-108
网址：www.csc108.com
(80)招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
法定代表人：霍达
电话：0755-82960167
传真：0755-82943636
联系人：黄婵君
客户服务热线：95565
网址：www.newone.com.cn
(81)广发证券股份有限公司
住所：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316 房)
办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 36 楼
法定代表人：孙树明
电话：020-87555888-8333
传真：020-87555305
联系人：黄岚
客户服务热线：95575
网址：www.gf.com.cn
(82)中信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 20 层
法定代表人：张佑君
电话：010-60834768
传真：010-60833739
联系人：杜杰
客户服务热线：95558
网址：www.cs.ecitic.com
(83)长江证券股份有限公司
住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人：尤习贵
电话：027-65799735
传真：027-85481900
联系人：付研
客户服务热线：400-888-8999
网址：www.95579.com
(84)安信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02
办公地址：深圳市福田区 2008 号中国深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层
法定代表人：王连志
电话：0755-82558038
传真：0755-82558355
联系人：郑向溢
客户服务热线：400-800-1001
网址：www.essence.com.cn
(85)民生证券股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座
办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层
法定代表人：余政
电话：010-85127629
传真：010-85127917
联系人：易楠
客户服务热线：400-619-8888
网址：www.mszq.com
(86)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层(1507-1510 室)
办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层(266061)
法定代表人：姜晓林
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
联系人：焦刚
客户服务热线：95548
网址：sd.citics.com
(87)信达证券股份有限公司
住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层
法定代表人：高冠江
电话：010-83252185
联系人：张晓晨
客户服务热线：400-800-8899
网址：www.cindasc.com
(88)光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路 1508 号
办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人：周健男
电话：021-22169089
传真：021-22169134
联系人：李芳芳
客户服务热线：95525
网址：www.ebscn.com
(89)大同证券经纪有限责任公司
住所：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12 层
办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12 层
法定代表人：董祥
电话：0351-4130322
联系人：薛津
客户服务热线：400-712-1212
网址：www.dtsbc.com.cn
(90)平安证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路中华国际交易广场 8 层
办公地址：深圳市福田区金田路中华国际交易广场 8 层
法定代表人：杨宇翔
电话：18612835256
传真：0755-82400862
联系人：周驰
客户服务热线：95511-8
网址：stock.pingan.com
(91)中山证券有限责任公司
注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层
办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层
法定代表人：黄扬录
电话：0755-82570586
联系人：罗艺琳
客户服务热线：95329
网址：www.zszq.com.cn
(92)东方财富股份有限公司
注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼
办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦 16 楼
法定代表人：陈宏
电话：021-23586603
联系人：付佳
客服电话：95357
网址：www.18.cn
(93)中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司
注册地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦五层
办公地址：上海市浦东新区商城路 618 号良友大厦 B303 室
法定代表人：窦玉明
电话：15800398962
联系人：孙茂
客服电话：400-700-9700
网址：www.zofund.com
(94)阳光人寿保险股份有限公司
注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层
办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层
法定代表人：李科
电话：010-59053660
联系人：王磊
客服电话：95510
网址：fund.sinosig.com
(95)泉州银行股份有限公司
住所：福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号
办公地址：福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号
法定代表人：傅子能
电话：0595-22551071
联系人：傅彩芬
客户服务热线：400-88-96312
网址：www.qzccbank.com
(96)江苏苏州农村商业银行股份有限公司
住所：江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号
办公地址：江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号
法定代表人：魏礼亚
电话：0512-63969209
联系人：葛晓亮
客户服务热线：400-86-96068
网址：www.wjrcb.com
(97)广东顺德农村商业银行股份有限公司
注册地址：佛山市顺德区大良街道办事处德和居委会拥翠路 2 号
办公地址：佛山市顺德区大良街道办事处德和居委会拥翠路 2 号
法定代表人：姚真勇
联系人：梁丽均
电话：0757-22387367
客服：0757-22223388
网站：www.sdebank.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调整为本基金的销售机构。
(二)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：胡晓明
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：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：黎明、陈颖华
联系人：陈颖华
(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：中国上海市湖滨路 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、周祎
联系人：周祎

四、基金的名称
本基金名称：天弘中证 500 指数型发起式证券投资基金。

五、基金的类型
本基金类型：股票型基金。

六、基金的投资目标
紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

七、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，以中证 500 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。
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：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略
(一) 投资策略
本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化(包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等)的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。
1、大类资产配置
本基金管理人主要按照中证 500 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
2、股票投资策略
(1)股票投资组合构建
本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况(例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素)，本基金将采用替代性的方法构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%的投资比例限制。
(2)股票投资组合的调整
本基金所构建的股票投资组合将根据中证 500 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。
1)定期调整
根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。
2)不定期调整
A. 当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出成份股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；
B. 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；
C. 根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。
在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
3、债券投资策略
本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。
4、资产支持证券投资策略
本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。
5、其他金融工具投资策略
本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。
(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)本基金管理人每月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，会议参加人员为全体投资研究团队。
(2)投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下，确定基金资产配置方案，并审批重大单项投资决定。
(3)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、投资研究联席会议讨论结果，制定基金的投资策略，在其权限范围内进行基金的日常投资组合管理工作。
(4)金融工程分析师运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对指数化投资的偏差风险和流动性风险进行测算，并提供数量化风险分析报告，行业分析师对标的指数成分股中基本面情况及时提供研究报告。
(5)基金经理根据量化风险分析报告，在追求相关度最大化和跟踪误差最小化的目标下，采取适当的方法控制与指数的偏差风险、流动性风险、降低交易成本。

九、业绩比较基准
本基金投资组合的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%＋银行活期存款利率(税后)×5%。
中证 500 指数扣除了沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票，再按照最近一年(新股为上市以来)的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的股票，然后将剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前 500 名的股票作为该指数样本股。该指数综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况，并能够作为投资业绩的评价标准，为指数化投资和指数衍生产品创新提供基础条件。
如果指数编制单位变更或停止中证 500 指数的编制、发布或授权，或中证 500 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为中证 500 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

十、风险收益特征
本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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。
基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定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 2019 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。以下内容摘自本基金 2019 年第 4 季度报告。

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	2,188,588,020.76	92.43
	其中:股票	2,188,588,020.76	92.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	155,723,105.96	6.58
8	其他资产	23,545,118.45	0.99
9	合计	2,367,856,245.17	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	14,731,276.00	0.64
B	采矿业	70,199,610.77	3.03
C	制造业	1,241,517,467.73	53.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,619,397.41	2.62
E	建筑业	28,557,289.68	1.23
F	批发和零售业	100,678,103.03	4.35
G	交通运输、仓储和邮政业	76,126,445.54	3.29
H	住宿和餐饮业	9,879,973.20	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	221,888,335.71	9.58
J	金融业	128,008,989.05	5.53
K	房地产业	86,677,284.21	3.74
L	租赁和商务服务业	30,973,649.30	1.34
M	科学研究和技术服务业	12,913,701.43	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	15,444,180.57	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,184,699.44	0.09
Q	卫生和社会工作	18,993,878.80	0.82
R	文化、体育和娱乐业	42,594,528.23	1.84
S	综合	22,515,789.89	0.97
	合计	2,184,504,599.99	94.30

2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,170,212.23	0.14
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	-	-
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	906,630.50	0.04
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	6,578.04	0.00
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	4,083,420.77	0.18

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
3.1 报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600745	闻泰科	173,100	16,011,750.00	0.69
2	000066	中国长	895,285	13,930,634.60	0.60
3	002463	沪电股	614,838	13,655,551.98	0.59
4	002384	东山精	573,154	13,268,515.10	0.57
5	601099	太平洋	3,475,100	13,170,629.00	0.57
6	601128	常熟银	1,397,077	12,727,371.47	0.55
7	600584	长电科	571,390	12,559,152.20	0.54
8	600426	华鲁恒	580,782	11,540,138.34	0.50
9	300383	光环新	550,980	11,058,168.60	0.48
10	002049	紫光国	216,500	11,006,860.00	0.48

3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688388	嘉元科	24,307	1,334,454.30	0.06
2	688001	华兴源	21,494	893,505.58	0.04
3	688088	虹软科	16,944	775,188.00	0.03
4	688321	微芯生	13,328	716,113.44	0.03
5	688058	宝兰德	1,450	131,442.50	0.01

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
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
本基金本报告期末未持有债券。
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
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2003	IC2003	9	9,416,880.00	328,080.00	-
公允价值变动总额合计(元)					328,080.00
股指期货投资本期收益(元)					4,256,148.09
股指期货投资本期公允价值变动(元)					1,258,320.00

9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本指数基金的股指期货买入套保主要为应对基金组合申购的资金未到位造成基金组合的股票仓位过低的风险，股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限。并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上，结合基金日常的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。
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 本报告编制日前一年内，本基金投资的前十名证券发行主体中，闻泰科技股份有限公司于 2019 年 08 月 12 日收到上海证券交易所的纪律处分决定书。太平洋证券股份有限公司分别于 2019 年 1 月 26 日和 2019 年 7 月 16 日收到中国证券监督管理委员会云南监管局行政处罚决定书和行政监管措施决定书。
对上述股票的投资决策程序说明：本基金为被动跟踪指数基金。根据本基金《基金合同》等相关规定，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，故按照成份股权重配置该等证券，符合法律法规、基金合同和公司内部投资决策程序的相关规定。
11.2 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。
11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,333,398.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	73,104.26
5	应收申购款	21,138,615.39
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	23,545,118.45

11.4 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。
11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。
11.5.2 期末积极投资前五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	688388	嘉元科技	1,334,454.30	0.06	科创板打新 限售
2	688001	华兴源创	893,505.58	0.04	科创板打新 限售
3	688088	虹软科技	775,188.00	0.03	科创板打新 限售
4	688321	微芯生物	716,113.44	0.03	科创板打新 限售
5	688058	宝兰德	131,442.50	0.01	科创板打新 限售

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。
本基金合同生效日 2015 年 01 月 20 日，基金业绩数据截至 2019 年 12 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
天弘中证 500A

阶段	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	①-③	②-④
2015/01/20-2015/12/31	21.02%	2.83%	42.29%	2.72%	-21.27%	0.11%
2016/01/01-2016/12/31	-16.42%	1.83%	-16.77%	1.81%	0.35%	0.02%
2017/01/01-2017/12/31	1.09%	0.87%	-0.13%	0.88%	1.22%	-0.01%
2018/01/01-2018/12/31	-30.09%	1.42%	-31.85%	1.43%	1.76%	-0.01%
2019/01/01-2019/12/31	26.99%	1.38%	25.09%	1.39%	1.90%	-0.01%
自合同生效日(2015/01/20)	-9.23%	1.78%	0.83%	1.74%	-10.06%	0.04%

天弘中证 500C

阶段	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	①-③	②-④
2018/04/25-2018/12/31	-26.84%	1.45%	-28.69%	1.47%	1.85%	-0.02%
2019/01/01-2019/12/31	26.74%	1.38%	25.09%	1.39%	1.65%	-0.01%
自基金份额首次确认日(2018/04/25)	-7.28%	1.41%	-10.80%	1.43%	3.52%	-0.02%

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、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
4、标的指数许可使用基点费；
5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
7、基金份额持有人大会费用；
8、基金的证券、期货交易费用；
9、基金的银行汇划费用；
10、证券、期货账户开户费用和银行账户维护费；
11、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。
(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 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×0.5%÷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 5 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 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.1%÷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 5 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、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费
本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×0.25%÷当年天数
H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费
E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值
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基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构。若遇法定节假日、公休日，支付日期顺延。
4、指数许可使用基点费
本基金指数许可使用费分为许可使用固定费和许可使用基点费，其中许可使用基点费由基金财产承担。
本基金指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的万分之二(2 个基点)的年费率计提。计算方法如下：
H=E×年费率 / 当年天数
H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值。
指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付。自基金合同生效日起，基金管理人、基金托管人和指数供应商核对一致后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前 10 个工作日内，由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用基点费划款指令，按照确认的金额和指定的账户路径将上一季度的指数许可使用基点费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。
许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 8000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。
基金管理人可根据指数使用许可协议和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数许可使用基点费费率和计费方式，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒介上刊登公告。
上述“(一)基金费用的种类中第 5－11 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。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十四、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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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 2019 年 8 月 31 日公告的《天弘中证 500 指数型发起式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、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、基金投资组合报告”相关内容，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核；
6、更新了“十一、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“二十三、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。
8、本招募说明书依据《信息披露办法》修订的其他内容。

天弘基金管理有限公司
二〇二〇年四月二十一日

证券代码：600734　　证券简称：实达集团　　编号：第 2020-020 号

福建实达集团股份有限公司关于延期披露 2019 年经审计年度报告的公告

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。

重要内容提示：
1.2019 年经审计年度报告原预计披露日期：2020 年 4 月 29 日
2.2019 年经审计年度报告延期后的披露时间：2020 年 6 月