（上接C79 版）

办公地址:北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层
法定代表人:齐剑辉
电话:15201586214
联系人:王永霞
客服电话:400-623-6060
网址:www.niuniufund.com

(114)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A
办公地址:深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A
法定代表人:高锋
电话:0755-83655588-605
联系人:廖嘉琦
客服电话:400-804-8688
网址:www.foreseakeynes.com

(115)上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
办公地址:上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼
法定代表人:王廷富
电话:021-68882280
联系人:徐亚丹
客服电话:400-820-9463
网址:www.wind.com.cn

(116)浦领基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08
法定代表人:李招弟
电话:13611256407
联系人:李艳
客服电话:400-059-8888
网址:www.wy-fund.com

(117)北京晟视天下基金销售有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 28 层
法定代表人:蒋煜
联系人:麦靖宜
电话:18501013913
客服:400-818-8866
网址:www.shengshiview.com

(118)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市北京经济技术开发区科创十一街 18 号 C 座 2 层 221 室
办公地址:北京市北京经济技术开发区科创十一街 18 号 C 座 2 层 222 室

……

法定代表人:王兴吉
联系人:马林
电话:18810292781
客服:400-088-8080
网址:www.qiandaojr.com

(128)深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108
办公地址:深圳市南山区科苑路科兴科学园 B3 栋 7F
法定代表人:赖任军
联系人:刘昕霞
电话:0755-29330513
客服:400-930-0660
网址:www.jfzinv.com

(129)北京植信基金销售有限公司
注册地址:北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67
办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号
法定代表人:杨纪峰
联系人:吴鹏
电话:18701358525
客服:4006-802-123
网址:www.zhixin-inv.com

(130)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室
办公地址:上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4F

……

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

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 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 | 51,406.41 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,487.99 |
| 5 | 应收申购款 | 188,121.78 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 243,016.18 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 2009 年 12 月 17 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

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2009/12/17-2009/12/31 | 0.70% | 0.14% | 0.36% | 1.40% | 0.34% | -1.26% |
| 2010/01/01-2010/12/31 | 17.54% | 1.60% | -9.21% | 1.19% | 26.75% | 0.41% |
| 2011/01/01-2011/12/31 | -25.66% | 1.40% | -18.60% | 0.97% | -7.06% | 0.43% |
| 2012/01/01-2012/12/31 | 3.18% | 1.44% | 5.83% | 0.96% | -2.65% | 0.48% |
| 2013/01/01-2013/12/31 | 24.77% | 1.32% | -6.65% | 1.05% | 31.42% | 0.27% |
| 2014/01/01-2014/12/31 | 24.95% | 1.05% | 39.63% | 0.91% | -14.68% | 0.14% |
| 2015/01/01-2015/12/31 | 66.70% | 2.91% | 6.84% | 1.86% | 59.86% | 1.05% |
| 2016/01/01-2016/12/31 | -28.61% | 2.09% | -8.59% | 1.05% | -20.02% | 1.04% |
| 2017/01/01-2017/12/31 | 22.34% | 1.08% | 14.78% | 0.48% | 7.56% | 0.60% |
| 2018/01/01-2018/12/31 | -27.09% | 1.61% | -18.09% | 1.00% | -9.00% | 0.61% |
| 2019/01/01-2019/12/31 | 41.50% | 1.29% | 26.80% | 0.93% | 14.70% | 0.36% |
| 自基金合同生效-2019/12/31 | 112.60% | 1.66% | 19.13% | 1.09% | 93.47% | 0.57% |

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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、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;

9、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。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(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 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.50%÷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 0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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。

上述“(一)基金费用的种类”中第 3-7 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 日在指定媒介上公告。

(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》、《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 12 月 28 日公告的《天弘周期策略混合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、更新了“重要提示”中相关内容;

2、更新了“三、基金管理人”中的相关内容;

3、更新了“四、基金托管人”中的相关内容;

4、更新了“五、相关服务机构” 中的相关内容;

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”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

（上接C81 版）

本基金管理人主要按照中证证券保险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%，投资于中证证券保险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。

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%,投资于中证证券保险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证券保险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;

……

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×销售服务费年费率÷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

……