

天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金 上市交易公告书

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

注册登记机构：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：2019年9月27日

公告日期：2019年9月24日

目录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览.....	3
三、基金的募集与上市交易.....	4
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	7
五、基金主要当事人简介.....	8
六、基金合同摘要.....	13
七、基金财务状况.....	13
八、基金投资组合.....	15
九、重大事件揭示.....	19
十、基金管理人承诺.....	19
十一、基金托管人承诺.....	20
十二、备查文件目录.....	20
附件：基金合同内容摘要.....	22

一、重要声明与提示

《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《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规则》的规定编制，天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金管理人天弘基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、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。本基金托管人国泰君安证券股份有限公司保证本公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。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2019年8月23日刊登在《中国证券报》及天弘基金管理有限公司网站（www.thfund.com.cn）上的《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

- 1、基金名称：天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金场内简称：创业板 TH
- 3、基金代码：159977
- 4、2019年9月20日基金份额总额：377,936,410.00份
- 5、2019年9月20日基金份额净值：1.7045元
- 6、本次上市交易份额：377,936,410.00份
- 7、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 8、上市交易日期：2019年9月27日

9、基金管理人：天弘基金管理有限公司

10、基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

11、上市推荐人：无

12、申购赎回代理券商：国泰君安、中信建投、安信证券、方正证券、西藏东方财富。

本公司可根据情况变更申购赎回代办券商。

三、基金的募集与上市交易

(一) 本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会 2019 年 7 月 30 日证监许可【2019】1409 号。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：2019 年 8 月 26 日至 2019 年 9 月 6 日。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售方式：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。

7、发售机构：

(1) 网下现金认购和网下股票认购的直销机构：天弘基金管理有限公司。

(2) 网上现金认购的发售代理机构：投资者可直接通过具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。具体名单如下：

国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、华西证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、华林证券股份有限公司、长城国瑞证券有限公司、中国民族证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、海通证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、华福证券有限责任

公司、长江证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司、英大证券有限责任公司、湘财证券股份有限公司、国开证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、首创证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、五矿证券有限公司、华金证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、开源证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、万联证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、联储证券有限责任公司、国都证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、万和证券股份有限公司、国融证券股份有限公司、川财证券有限责任公司、恒泰长财证券有限责任公司、财达证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、爱建证券有限责任公司、宏信证券有限责任公司、中航证券有限公司、财富证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、中邮证券有限责任公司、九州证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、财通证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、上海华信证券有限责任公司、网信证券有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、长江证券承销保荐有限公司、江海证券有限公司、中天证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、中天国富证券有限公司、高盛高华证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司、中德证券有限责任公司、华英证券有限责任公司、第一创业证券承销保荐有限责任公司、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司、东方花旗证券有限公司、金通证券有限责任公司、申万宏源证券承销保荐有限责任公司、申港证券股份有限公司、华菁证券有限公司、汇丰前海

证券有限责任公司、东亚前海证券有限责任公司、中国证券金融股份有限公司、中国信达资产管理公司、中国华融资产管理公司、中国东方资产管理公司、中国长城资产管理公司、野村证券株式会社上海代表处、群益国际控股有限公司上海代表处、内藤证券公司上海代表处等（排名不分先后）。

（3）网下现金认购和网下股票认购的发售代理机构：国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、西藏东方财富股份有限公司。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况

此次募集扣除认购费后的有效净认购金额（不含利息）为 640,778,160.00 元人民币（含所募集股票市值），认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计 80,278.00 元人民币。

上述有效净认购资金已于 2019 年 9 月 11 日全部划至本基金托管人国泰君安证券股份有限公司的基金托管账户。认购款项在募集期间产生的利息已于 2019 年 9 月 23 日划入基金托管账户。

本次募集有效认购户数为 10,436 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 640,858,438.00 份，已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

10、基金备案情况

根据《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》以及《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于 2019 年 9 月 12 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，基金管理人开始正式管理本基金。

11、基金合同生效日：2019 年 9 月 12 日。

12、基金合同生效日的基金份额总额：640,858,438.00 份。

13、基金份额折算

根据《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，天弘基金管理有限公司决定对本基金进行基金份额折算与变更登记，并确定 2019 年 9 月 19 日为基金份额折算日。本次基金份额折算前基金份额总额为 640,858,438.00 份，折算前基金份额净值为 1.0059 元。根据本次基金份额折算前基金份额折算的公告约定的基金份额折算公式，本次基金份额折算比例为 0.58974180，折算后基金份额总额为 377,936,410.00 份，折算后基金份额净值为 1.7056 元。本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，本基金登记结算机构已于 2019 年 9 月 20 日进行了变更登记。

（二）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〔2019〕581 号
- 2、上市交易日期：2019 年 9 月 27 日
- 3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 4、基金场内简称：创业板 TH
- 5、基金交易代码：159977
- 6、本次上市交易份额：377,936,410.00 份
- 7、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至 2019 年 9 月 20 日，本基金场内份额持有人户数为 10,436 户，平均每户持有的基金份额为 36,214.68 份。

（二）持有人结构

截至 2019 年 9 月 20 日，本基金份额持有人结构如下：机构投资者持有的基金份额为 63,340,794.00 份，占基金总份额的 16.7596%；个人投资者持有的基金份额为 314,595,616.00 份，占基金总份额的 83.2404%。

(三) 截至 2019 年 9 月 20 日, 前十名基金份额持有人的情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例 (%)
1	渤海国际信托股份有限公司—渤海信托·2019 灵活配置单一资金信托	58,990,692.00	15.6086%
2	赵鸿飞	11,139,927.00	2.9476%
3	辛秀峰	1,651,420.00	0.4370%
4	王志军	1,179,644.00	0.3121%
5	徐志斌	1,179,644.00	0.3121%
6	王清	1,179,574.00	0.3121%
7	曹寅	990,900.00	0.2622%
8	许萍	930,630.00	0.2462%
9	楼春涛	884,681.00	0.2341%
10	邢久策	782,692.00	0.2071%

注: 以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

1、基金管理人概况

名称: 天弘基金管理有限公司

法定代表人: 井贤栋

总经理: 郭树强

信息披露负责人: 童建林

联系电话: 022-83310208

注册资本: 5.143 亿元人民币

注册地址：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦 A 座 1704-241 号

设立批准文号：中国证监会证监基字[2004]164 号

工商登记注册的统一社会信用代码：91120116767620408K

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事特定客户资产管理业务、中国证监会许可的其他业务。

2、股权结构

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

3、内部组织结构及职能

本基金管理人设置了合理的组织结构，并根据业务需要进行了充足的人员配置。

本基金管理人业务部门主要分为投资研究、市场营销、风控合规、基金运营、技术保障等部门。其中，投研部门主要负责投资研究、投资管理、投资交易等工作；市场营销部门主要负责产品营销和市场推广等工作；风控合规主要负责公司及业务全流程合规保障、风险控制等工作；基金运营和技术保障主要负责会计估值与核算、注册登记等日常运营业务以及信息系统的管理和维护等工作。上述部门的设置为基金运作各环节做好充分准备。

4、人员情况

截至 2019 年 8 月 31 日，本基金管理人共有员工 519 人，其中 96%以上具有本科及以上学历。其中，投研体系 113 人、市场营销部门 161 人、基金运营部

45 人、信息技术部 90 人、风控合规内审部 32 人、产品部 9 人、品牌管理部 6 人，客户服务部 16 人、人力财务综合 47 人。

5、基金管理业务介绍

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2004]164 号文批准，于 2004 年 11 月 8 日正式成立，注册资本金为 5.143 亿元人民币。公司总部设在天津，在北京、上海、广州、天津、深圳、四川设有分公司，并在北京设有子公司。自成立以来，始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人（含专户和子公司产品）资产管理总规模 12,999.48 亿元。其中，公募基金资管规模 12,039.42 亿元，成立以来累计为公募持有人赚取收益 2,014.05 亿元；专户规模 505.38 亿元；子公司产品规模 454.69 亿元。截至 2019 年 6 月 30 日，共管理 49 只公募基金，业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资，以及股权、债权、其他财产权利投资等。

6、本基金基金经理

杨超先生，英国威尔士大学金融数学与计算硕士学位，9 年证券从业经验。历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理；泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019 年 1 月加盟本公司，历任天弘创业板指数型发起式证券投资基金基金经理（2019 年 6 月至 2019 年 9 月）。现任指数与数量投资部副总经理，天弘中证 500 指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘沪深 300 指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

张子法先生，北京大学软件工程硕士学位，10 年以上证券从业经验。历任建设银行聊城市分行任金融软件项目科员，北京中联集团金融软件项目经理，上海华腾软件系统公司金融项目经理，华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。2014 年 3 月加盟本公司，历任高级数据工程师、基金经理助理、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金基金经理（2017 年 4 月至 2018 年 9 月）、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金基金经理（2017 年 4 月至 2018 年 9 月）、天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金基金经理（2017 年 4 月至

2018年9月)、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金基金经理(2017年4月至2018年9月)、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(2017年4月至2018年9月)、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金基金经理(2017年4月至2018年10月)、天弘量化驱动股票型证券投资基金基金经理(2018年1月至2019年8月)、天弘创业板指数型发起式证券投资基金基金经理(2017年4月至2019年9月)。现任天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘上证50指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证计算机主题指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理。

(二) 基金托管人

1、基本情况

名称：国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市静安区新闻路669号博华广场19楼

法定代表人：杨德红

成立时间：1999年8月18日

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：人民币890794.7954万元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可[2014]511号

基金托管部负责人：陈忠义

信息披露负责人：王健

联系电话：021-38917599-5

2、主要人员情况

陈忠义先生，中国国籍，无境外居留权，1970年10月出生，经济学学士，中级经济师，现任国泰君安证券资产托管部总经理。1993年参加工作，曾任职于君安证券清算部总经理助理、国泰君安证券营运中心副总经理、光大证券营运管理总部总经理等职。“全国金融五一劳动奖章”、“金融服务能手”称号获得者，中国证券业协会托管结算专业委员会副主任委员，带领团队设计的“直通式证券清算质量管理国际化标准平台”，被评为上海市2011年度金融创新奖二等奖。2014年2月起任国泰君安证券资产托管部总经理。

国泰君安证券总部设资产托管部，现有员工全部具备基金从业资格及本科以上学历，管理人员及业务骨干均具有多年基金、证券和银行的从业经验，从业人员囊括了经济师、会计师、注册会计师、律师、国际注册内部审计师等中高级专业技术职称及专业资格，专业背景覆盖了金融、会计、经济、法律、计算机等各领域，是一支诚实勤勉、积极进取、专业分布合理，职业技能优良的资产托管从业人员队伍。

3、基金托管业务经营情况

国泰君安证券于2013年4月3日取得私募基金综合托管业务资格，于2014年5月20日取得证券投资基金托管资格，可为各类公开募集基金、非公开募集基金提供托管服务。国泰君安证券坚守“诚信专业、质量为本”的服务宗旨，通过组建经验丰富的专业团队、搭建安全高效的业务系统，为基金份额持有人提供值得信赖的托管服务。国泰君安证券获得证券投资基金托管资格以来，广泛开展了公募基金、基金专户、券商资管计划、私募基金等基金托管业务，与建信、富国、华安、长信、中融等多家基金公司及其子公司建立了托管合作关系。截至2019年7月31日托管与外包产品累计超万只，总规模超万亿，托管产品类型涉及公募基金、私募基金、基金专户、资产管理计划等，其中托管公募基金25只，产品类型涉及货币市场基金、债券型证券投资基金、指数型证券投资基金、混合型证券投资基金等，专业的服务和可靠的运营获得了管理人的一致认可。

（三）上市推荐人

无

（四）基金验资机构

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

经办注册会计师：薛竞、周祎

联系人：周祎

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用不从基金资产中支付。

（二）基金上市前重要财务事项

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。

（三）基金资产负债表

本基金 2019 年 9 月 20 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	本期末 2019 年 09 月 20 日
资 产：	
银行存款	41,077,911.75
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	625,843,008.60
其中：股票投资	625,843,008.60
基金投资	-

债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	334,629.46
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	91,891.90
资产总计	667,347,441.71
负债和所有者权益	本期末 2019年09月20日
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	22,896,672.07
应付赎回款	-
应付管理人报酬	70,422.73
应付托管费	14,084.54
应付销售服务费	-
应付交易费用	146,215.43
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	9,090.22
负债合计	23,136,484.99

所有者权益：	
实收基金	640,858,438.00
未分配利润	3,352,518.72
所有者权益合计	644,210,956.72
负债和所有者权益总计	667,347,441.71

八、基金投资组合

截至 2019 年 9 月 20 日，本基金的投资组合如下：

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	625,843,008.60	93.78
	其中：股票	-	-
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合计	41,077,911.75	6.16
8	其他资产	426,521.36	0.06
9	合计	667,347,441.71	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	68,149,848.00	10.58
B	采矿业	-	-
C	制造业	309,171,459.00	47.99
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	155,336,261.60	24.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,255,250.00	0.82
M	科学研究和技术服务 业	13,207,172.00	2.05
N	水利、环境和公共设施 管理业	8,158,092.00	1.27
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	38,966,057.00	6.05
R	文化、体育和娱乐业	27,598,869.00	4.28
S	综合	-	-
	合计	625,843,008.60	97.15

2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300498	温氏股份	1,762,800	68,149,848.00	10.58%
2	300059	东方财富	2,352,300	36,789,972.00	5.71%
3	300750	宁德时代	343,300	25,699,438.00	3.99%
4	300015	爱尔眼科	557,600	19,822,680.00	3.08%
5	300142	沃森生物	586,100	16,563,186.00	2.57%
6	300347	泰格医药	235,700	14,561,546.00	2.26%
7	300003	乐普医疗	525,200	14,064,856.00	2.18%
8	300136	信维通信	376,000	13,772,880.00	2.14%
9	300124	汇川技术	505,000	12,362,400.00	1.92%
10	300760	迈瑞医疗	60,100	11,248,316.00	1.75%

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	334,629.46
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	其他	91,891.90
8	合计	426,521.36

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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。

九、重大事件揭示

（一）2019年9月13日发布天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告。

（二）2019年9月18日发布天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告。

（三）2019年9月23日发布天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本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、深圳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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二) 根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，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、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的公司住所和深圳证券交易所，投资者可在办公时间免费查阅。

- (一) 中国证监会准予本基金募集注册的文件
- (二) 《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- (四) 《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(五) 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

天弘基金管理有限公司

二〇一九年九月二十四日

附件：基金合同内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利和义务

(一) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 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；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法进行融资及转融通证券出借业务；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 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、赎回等的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，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、谨慎勤勉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基金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，不得利用基金财产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) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的对价，编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 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；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；

(13) 按《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基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

(15) 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；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(18) 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；

(19) 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；

(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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 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实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括

但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 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费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》、托管协议及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、为基金办理证券、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，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) 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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》、托管协议及其他有关规定外，不得利用基金财产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等投资所需账户，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；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》、托管协议及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价的现金部分；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，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；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 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对价的现金部分；

(15) 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管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》、托管协议的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 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；

(18) 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，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《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《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (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) 依法并按照基金合同和招募说明书的规定转让或者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或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购款项或认购股票、申购对价、现金差额及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其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；

- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；
- (10) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

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，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

在本基金成功募集并运作之后，如基金管理人管理本基金的联接基金的：

鉴于本基金和本基金联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金联接基金的基金份额直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会表决。在计算参会份额和计票时，本基金联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，本基金联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金联接基金份额占本基金联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

本基金联接基金的基金管理人不应以本基金联接基金的名义代表本基金联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金联接基金的特定基金份额持有人的委托以本基金联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金联接基金的基金管理人代表本基金联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照本基金联接基金基金合同的约定召开本基金联接基金的基金份额持有人大会，本基金联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由本基金联接基金的基金管理人代表本基金联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》，但基金合同另有约定的除外；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略，但基金合同另有约定除外；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 终止基金上市，但因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) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- (3) 因相应的法律法规、相关证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (4) 对《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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 基金推出新业务或服务；

(6) 调整本基金份额类别的设置；

(7) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、基金交易、非交易过户等业务规则（包括但不限于申购赎回清单的调整、开放时间的调整等）；

(8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《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。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、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，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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（含 10%）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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）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，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。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。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(三) 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、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点和会议形式；

(2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

(3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4) 授权委托证明的内容要求（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；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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，不影响表决意见的计票效力。

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开

会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之

一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中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，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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。

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下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表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所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次

基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议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）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，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 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

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，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项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，特别决议应当经参加大会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）通过方可做出。除基金合同另有规定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，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。

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。

（七）计票

1、现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，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选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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒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。

(八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。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。

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的决议。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。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，经与基金托管人协商一致，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一) 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

(二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

(三) 基金收益分配原则

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配方式为现金分红；
- 3、基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，基金管理人可以进行收益分配；在收益评价日，基金管理人将基金净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法参见招募说明书；
- 4、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；
- 5、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，无需召开基金份额持有人大会。

(四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

(五) 收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（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、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费；
- 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、律师费和诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易、结算费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金上市费及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 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：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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：

$$H=E\times 0.1\%\div \text{当年天数}$$

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、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。指数许可使用费的费率及支付方法在招募说明书中列示。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法及费率。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—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

本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率

适用中国税务主管机关的规定。

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。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）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。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。

（二）投资范围

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许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）。

本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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。

（三）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 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%；

(3) 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%；

(4) 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%；

(5) 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%；

(6) 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；

(7) 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；

(8) 基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(9) 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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(10) 本基金参与股指期货交易，依据下列标准建构组合：

在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(11) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值

的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(12) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(13) 在最近 6 个月内日均基金资产净值不低于 2 亿元的前提下，本基金可参与转融通证券出借交易。本基金参与转融通证券出借交易的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应适用本条第（11）款的限制规定；同时，本基金参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 30%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算。

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

(15) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述（6）、（11）、（13）、（14）情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。

2、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) 违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 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；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(二) 基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回且未上市交易前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回或基金上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日/交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

四、争议的处理

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，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其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，各方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。

《基金合同》受中华人民共和国(不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区)法律管辖。

五、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。