

天弘中证银行指数型发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

日期：二〇一九年二月

重要提示

天弘中证银行指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 6 月 23 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2015】1344 号）。本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会备案，但中国证监会接受本基金募集注册的备案，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。本基金的基金合同于 2015 年 7 月 8 日正式生效。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，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。本基金并非保本基金，基金管理人并不能保证投资于本基金不会产生亏损。投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件，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，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并按监管要求履行相关程序。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。基金招募说明书自基金合同生效之日起，每 6 个月更新一次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告。本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 01 月 08 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

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 层成立日期：2004 年 11 月 8 日法定代表人：井贤栋客服电话：95046 联系人：司媛组织形式：有限责任公司注册资本及股权结构：天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）经中国证券监督管理委员会批准（证监基金字[2004]164 号），于 2004 年 11 月 8 日成立。公司注册资本为人民币 5.143 亿元，股权结构为：

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%

（二）主要人员情况

1、董事会成员基本情况

井贤栋先生，董事长，硕士研究生。历任太古饮料有限公司财务总监、广州百事可乐有限公司首席财务官、阿里巴巴（中国）信息技术有限公司财务副总裁、支付宝（中国）网络技术有限公司首席财务官，浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司首席运营官，现任浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司董事长兼总经理。卢信群先生，副董事长，硕士研究生。历任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、副总经理、财务总监、董事会秘书，北京博晖创新光电技术股份有限公司监事。现任北京博晖创新生物技术股份有限公司董事长、总经理，北京博昂尼克微流体技术有限公司董事长，君正国际投资（北京）有限公司董事，河北大安制药有限公司董事，广东卫伦生物制药有限公司董事。屠剑威先生，董事，硕士研究生。历任中国工商银行浙江省分行营业部法律事务处案件管理科副科长、香港永亨银行有限公司上海分行法律合规监察部经理、花旗银行（中国）有限公司合规部助理总裁、永亨银行（中国）有限公司法律合规部主管。现任浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司法务及合规部高级研究员。祖国明先生，董事，大学本科。历任中国证券市场研究设计中心工程师、和讯信息科技有限公司 COO 助理、浙江淘宝网络有限公司总监。现任支付宝（中国）网络技术有限公司北京分公司资深总监。付岩先生，董事，大学本科。历任北洋（天津）物产集团有限公司期货部交易员，中国经济开发信托投资公司天津证券部投资部职员，顺驰（中国）地产有限公司资产管理部高级经理、天津信托有限责任公司投资银行部项目经理。现任天津信托有限责任公司总经理助理、自营业务部总经理、投资发展部总经理。郭树强先生，董事，总经理，硕士研究生。历任华夏基金管理有限公司交易主管、基金经理、研究总监、机构投资总监、投资决策委员会委员、机构投资决策委员会主任、公司管委会委员、公司总经理助理。现任本公司总经理。魏新顺先生，独立董事，大学本科。历任天津市政府法制办执法监督处副处长，天津市政府法制办经济法规处处长，天津达天律师事务所律师。现任天津英联律师事务所主任律师。张军先生，独立董事，博士。现任复旦大学经济学院教授。贺强先生，独立董事，本科。现任中央财经大学金融学院教授。

2、监事会成员基本情况

李琦先生，监事会主席，硕士研究生。历任天津市民政局事业处团委副书记，天津市人民政府法制办公室、天津市外经贸委办公室干部，天津信托有限责任公司条法处处长、总经理助理兼条法处处长、副总经理，本公司董事长。张杰先生，监事，注册会计师、注册审计师。现任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，锡林浩特市君正能源化工有限责任公司董事长，锡林郭勒盟君正能源化工有限责任公司执行董事、总经理，内蒙古君正化工有限责任公司监事，乌海市君正矿业有限责任公司监事，鄂尔多斯市君正能源化工有限公司监事，乌海市神华君正实业有限责任公司监事会主席，内蒙古坤德物流股份有限公司监事，内蒙古君正天原化工有限责任公司监事，内蒙古君正互联网小额贷款有限公司董事长。李渊，监事，硕士研究生。历任北京朗山律师事务所律师。现任芜湖高新投资有限公司法务总监。韩海潮先生，监事，硕士研究生。历任三峡证券天津白堤路营业部、勤俭道营业部信息技术部经理，亚洲证券天津勤俭道营业部营运总监。现任本公司运营总监、信息技术总监。张牡霞女士，监事，硕士研究生。历任新华社上海证券报财经要闻部记者、本公司市场部电子商务专员、电子商务部业务拓展主管、总经理助理，现任本公司互联网金融业务部总经理。付颖女士，监事，硕士研究生。历任本公司内控合规部信息披露专员、法务专员、合规专员、高级合规经理、部门主管。现任本公司内控合规部总经理。

3、高级管理人员基本情况

郭树强先生，董事，总经理，简历参见董事会成员基本情况。陈钢先生，副总经理，硕士研究生。历任华龙证券公司固定收益部高级经理，北京宸星投资管理公司投资经理，兴业证券公司债券总部研究部经理，银华基金管理有限公司机构理财部高级经理，中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2011年7月份加盟本公司，现任公司副总经理、固定收益总监、资深基金经理，分管公司固定收益投资业务。周晓明先生，副总经理，硕士研究生。历任中国证券市场研究院设计中心及其下属北京标准股份制咨询公司经理，万通企业集团总裁助理，中工信托有限公司投资部副总，国信证券北京投资银行一部经理，北京证券投资银行部副总，嘉实基金市场部副总监、渠道部总监，香港汇富集团高级副总裁，工银瑞信基金市场部副总监，嘉实基金产品和营销总监，盛世基金拟任总经理。2011年8月加盟本公司，同月被任命为公司首席市场官，现任公司副总经理，分管公司电子商务及产品业务。熊军先生，副总经理，财政学博士。历任中央教育科学研究所助理研究员，国家国有资产管理局主任科员、副处长，财政部干部教育中心副处长，全国社保基金理事会副处长、处长、副主任、巡视员。2017年3月加盟本公司，任命为公司首席经济学家，现任公司副总经理，分管智能投资研究部及养老金业务。童建林先生，督察长，大学本科，高级会计师。历任当阳市产权证券交易中心财务部经理、副总经理，亚洲证券有限责任公司宜昌总部财务主管、宜昌营业部财务部经理、公司财务会计总部财务主管，华泰证券有限责任公司上海总部财务项目主管。2006年8月加盟本公司，历任基金会计、内控合规部副总经理、内控合规部总经理。现任本公司督察长。

4、本基金基金经理

张子法先生，北京大学软件工程硕士学位，17年证券从业经验。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）。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、天弘创业板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、天弘量化驱动股票型证券投资基金基金经理。

陈瑶女士，金融学硕士学位，8年证券从业经验。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理，程序化交易策略、基差交易策略、融资融券交易策略等研究工作。历任天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金基金经理（2018年2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（2018年2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（2018年2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（2018年2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（2018年2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）。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、天弘创业板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、天弘中证环保产业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。历任基金经理：刘冬先生，任职时间：2015年7月9日至2017

年 4 月 17 日。

5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

陈钢先生，本公司副总经理，投资决策委员会联席主席、固定收益总监、基金经理。熊军先生，本公司副总经理，投资决策委员会联席主席、公司首席经济学家。邓强先生，首席风控官。肖志刚先生，股票投资总监，基金经理。黄颖女士，研究总监。王登峰先生，固定收益部总经理，基金经理。钱文成先生，基金经理。刘冬先生，基金经理。陈国光先生，基金经理。姜晓丽女士，基金经理。王林先生，基金经理。上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基金托管人基本情况

名称：招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

成立时间：1993 年 8 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：66.99 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可[2014]78 号

联系人：秦湘

联系电话：0755-26951111

招商证券是百年招商局旗下金融企业，经过二十多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商，并经中国证券监督管理委员会评定为 A 类 AA 级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力、科学合理的风险管理架构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道，在北京、上海、广州、深圳等城市拥有 243 家批准设立的证券营业部和 12 家证券经纪业务管理分公司，同时在香港设有分支机构，全资拥有招商证券国际有限公司、招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司，参股博时基金管理公司、招商基金管理公司、广东金融高新区股权交易中心有限公司及证通股份有限公司，构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力，打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越的金融服务实现客户价值增长，推动证券行业进步，立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构，成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

2、主要人员情况

招商证券托管部员工多人拥有证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验，以及大型 IT 公司的软件设计与开发经验，人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，其中本科以上学历占比 100%，高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。

3、基金托管业务经营情况

招商证券是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实信用、谨慎勤勉”的原则，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外，招商证券于 2012 年 10 月获得了证监会准许开展私募基金综合托管服务试点的正式批复，成为业内首家可从事私募托管业务的券商，经验丰富，服务优质，业绩突出。截至 2018 年四季度，招商证券共托管 31 只公募基金。

三、相关服务机构

(一) 基金销售机构

1、直销机构:

(1) 天弘基金管理有限公司直销中心住所: 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: 井贤栋电话: (022) 83865560 传真: (022) 83865563 联系人: 司媛客服电话: 95046

2、其他销售机构:

(1) 平安银行股份有限公司注册地址: 深圳市深南东路 5047 号办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号平安金融大厦 9 楼法定代表人: 孙建一电话: 021-50979356 传真: 021-50979507 联系人: 施艺帆客户服务热线: 95511-3 网址: bank.pingan.com (2) 平安证券股份有限公司注册地址: 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: 0755-22626391 传真: 0755-82400862 联系人: 周驰客户服务热线: 95511-8 网址: stock.pingan.com (3) 光大证券股份有限公司注册地址: 上海市静安区新闻路 1508 号办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号法定代表人: 周健男电话: 021-22169999/021-22169490 传真: 021-22169134 联系人: 姚巍客户服务热线: 95525 网址: www.ebscn.com (4) 招商证券股份有限公司注册地址: 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号办公地址: 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号招商证券大厦 23 层法定代表人: 霍达电话: 0755-82943666 传真: 0755-82943636 联系人: 黄婵君客户服务热线: 400-8888-111/95565 网址: www.newone.com.cn (5) 新时代证券股份有限公司注册地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 办公地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 法定代表人: 叶顺德电话: 010-83561146 传真: 010-83561094 联系人: 田芳芳客户服务热线: 95399 网址: www.xsdzq.cn (6) 中信建投证券股份有限公司注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号法定代表人: 王常青电话: 010-65183880 传真: 010-65182261 联系人: 刘芸客户服务热线: 400-8888-108 网址: www.csc108.com (7) 长江证券股份有限公司注册地址: 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: 027-65799999 传真: 027-85481900 联系人: 奚博宇客户服务热线: 400-888-8999 网址: www.95579.com (8) 安信证券股份有限公司注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 办公地址: 深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层法定代表: 牛冠兴电话: 0755-82558305 传真: 0755-82558355 联系人: 郑向溢网址: www.essence.com.cn (9) 信达证券股份有限公司注册地址: 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(信达证券)法定代表人: 高冠江电话: 010-83252183 联系人: 尹旭航客户服务热线: 400-800-8899 网址: www.cindasc.com (10) 中信证券股份有限公司注册地址: 广东省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: 王东明电话: 010-60838888 传真: 010-60833739 联系人: 秦夏客户服务热线: 95558 网址: www.cs.ecitic.com (11) 民生证券股份有限公司注册地址: 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: 010-85127609 传真: 010-85127917 联系人: 韩秀萍客户服务热线: 400-619-8888 网址: www.msyzq.com (12) 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: 杨宝林电话: 0532-85022326 传真: 0532-85022605 联系人: 孙秋月客户服务热线: 0532-95548 网址: www.zxwt.com.cn (13) 广发证券股份有限公司注册地址: 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: 广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼法定代表人: 孙树明电话: 020-87555888 传真: 020-87555305 联系人: 王磊客户服务热线: 95575 网址: www.gf.com.cn (14) 大同证券经纪有限责任公司注册地址: 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: 4007121212 网址: www.dtsbc.com.cn (15) 中信期货有限公司注册地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层办公地址: 深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦 14 层法定代表人: 张皓电话: 0755-82570586 联系人: 刘宏莹客户服务热线: 400-9908-826 网址: www.citicsf.com (16) 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大厦 7 层、8 层办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 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 (17) 中天证券股份有限公司注册地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲 办公地址：沈阳市和平区南五马路 121 号万丽城晶座 4 楼法定代表人：马功勋电话：024-2328 0842 联系人：孙丹华客户服务热线：024-95346 网址：www.iztzq.com (18) 万联证券股份有限公司注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层办公地址：广州天河区珠江东路高德置地秋广场 E 栋 12 楼法定代表人：张建军电话：020-38286026 联系人：甘蕾客户服务热线：95322 网址：www.wlzq.cn (19) 长城证券股份有限公司注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业 14 楼、16 楼、17 楼办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业 14 楼、16 楼、17 楼法定代表人：丁益电话：0755-83516289 联系人：金夏客户服务热线：400-6666-888 网址：www.cgws.com (20) 天津农村商业银行股份有限公司注册地址：天津市河西区马场道 59 号国际经济贸易中心 A 座 1-6 层办公地址：天津市河西区马场道 59 号国际经济贸易中心 A 座 1-6 层法定代表人：殷金宝电话：022-83872155 联系人：满与谦客服电话：96155 网址：www.trcbank.com.cn (21) 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：<http://fund.sinosig.com/> (22) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F 法人代表：陈柏青电话：0571-26888888 联系人：韩爱彬客服电话：400-0766-123 网站：www.fund123.cn (23) 上海天天基金销售有限公司注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼东方财富大厦 2 楼 办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼法定代表人：其实电话：186-1170-5311 联系人：丁姗姗客户服务热线：400-181-8188 网址：www.1234567.com.cn (24) 上海好买基金销售有限公司注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼（200120）法定代表人：杨文斌电话：13661870024 联系人：徐超逸客户服务热线：400-700-9665 网址：www.ehowbuy.com (25) 浙江同花顺基金销售有限公司注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼法人代表：凌顺平电话：13675861499 联系人：吴杰客服电话：400-877-3772 网址：www.5ifund.com (26) 和讯信息科技有限公司注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层法定代表人：王莉电话：18612966161 联系人：张洪亮客服电话：010-85657576、010-85657353 网址：www.licaike.com (27) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 37244 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 法定代表人：汪静波联系电话：15618885038 联系人：余翼飞客服电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com (28) 深圳众禄基金销售有限公司注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元 办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元法定代表人：薛峰 电话：0755-33227950 联系人：童彩平客服电话：400-6788-887 网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com (29) 北京展恒基金销售有限公司注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层法定代表人：闫振杰电话：010-59601366-7024 联系人：刘静客服电话：400-888-6661 网址：www.myfund.com (30) 珠海盈米财富管理有限公司注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203 法人代表：肖雯电话：13923214111 联系人：黄敏嫦客服电话：020-89629066 网址：www.yingmi.cn (31) 上海陆金所基金销售有限公司注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼法人代表：郭坚电话：15921301165 联系人：程晨客服电话：400-866-6618 网址：www.lu.com (32) 北京恒天明泽基金销售有限公司注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层法人代表：梁越电话：18641514414 联系人：张鼎客服电话：400-898-0618 网址：www.chtfund.com (33) 上海长量基金销售投资顾问有限公司注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层法

人代表:张跃伟电话:021-20691832 联系人:詹慧萌客服电话:400-820-2899 网址:www.erichfund.com(34) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲一号环球财讯中心A座5层法人代表:彭运年电话:010-59336519 联系人:孙雯客服电话:010-59336512 网址:www.jnlc.com(35) 北京虹点基金销售有限公司注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室办公地址北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层法人代表:胡伟电话:18513699505 联系人:陈铭洲客服电话:400-068-1176 网址:www.jimu.com(36) 嘉实财富管理有限公司注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层法人代表:赵学军电话:010-60842306 联系人:李雯客服电话:400-021-8850 网站:www.harvestwm.cn(37) 北京钱景基金销售有限公司注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 办公地址:北京市海淀区丹棱街6号丹棱soho1008-1012 法人代表:赵荣春电话:18501250851 联系人:陈剑炜 客服电话:400-893-6885 网站:www.dyxtw.com(38) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海公园3号办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海公园3号法定代表人:林卓电话:021-65681111-119 联系人:徐江客服电话:400-641-1999 网站:www.taichengziben.com(39) 北京加和基金销售有限公司注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层办公地址:北京市西城区北礼士路甲129号文化创新工场四层404 法人代表:徐福星 电话:13811685981 联系人:王晨客服电话:400-600-0030 网址:www.bzfunds.com(40) 深圳富济基金销售有限公司注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室办公地址:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室法人代表:齐小贺电话:0755-83999907-806 联系人:刘勇客服电话:0755-83999907 网址:www.jinqianwo.cn(41) 上海汇付基金销售有限公司注册地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼办公地址:上海市徐汇区虹梅路1801号凯科国际大厦7楼法人代表:冯修敏电话:18001713632/021-54677088-6726 联系人:甄宝林客服电话:021-34013996 网址:www.hotjijin.com(42) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层法人代表:杨懿电话:18502354557 联系人:文雯客服电话:400-166-1188 网址:8.jrj.com.cn(43) 上海中正达广基金销售有限公司注册地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室法人代表:黄欣电话:13774232592 联系人:戴珉微客服电话:400-676-7523 网址:www.zzwealth.cn(44) 浙江金观诚基金销售有限公司注册地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室办公地址:浙江省杭州市登云路43号金诚集团10楼法人代表:徐黎云电话:0571-88337717 联系人:孙成岩客服电话:400-068-0058 网址:www.jincheng-fund.com(45) 大泰金石基金销售有限公司注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室办公地址:南京市建邺区江东中路222号奥体中心文体创业园法人代表:袁顾明电话:021-22267994 联系人:赵明客服电话:400-928-2266 网址:www.dtfunds.com(46) 北京蛋卷基金销售有限公司注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院望京SOHO塔319层法人代表:钟斐斐电话:15910450297 联系人:侯芳芳客服电话:400-061-8518 网站:www.ncfj.com(47) 泰信财富投资管理有限公司注册地址:北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层8995房间办公地址:北京市朝阳区建国路甲92号世茂大厦C座5层法定代表人:李静电话:13601264918 联系人:李丹 客服电话:400-881-5596 网址:www.taixincf.com(48) 上海利得基金销售有限公司注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦10楼 办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼法人代表:沈继伟电话:18901780806 联系人:陈洁客服电话:400-921-7733 网址:www.leadbank.com.cn(49) 上海联泰基金销售有限公司注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层法人代表:燕斌电话:021-52822063 联系人:陈东客服电话:400-046-6788 网址:www.66zichan.com(50) 北京新浪仓石基金销售有限公司注册地址:北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室办公地址:北京海淀区中关村海淀北2街10号泰鹏大厦12楼法定代表人:张琪电话:18511773539 联系人:李唯客服电话:010-62676979 网址:www.xincai.com(51) 北京广源达信投资管理有限公司注册地址:北京市西城区新街

口外大街 28 号 C 座六层 605 室办公地址: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 (52)

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 (53)

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 (54)

众升财富(北京)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 (55)

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:陈超电话:18612439949 联系人:黄立影客服电话:400-088-8816 网址:jr.jd.com (56)

北京汇成基金销售有限公司注册地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号办公地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号法定代表人:王伟刚电话:18001102931 联系人:丁向坤客服电话:400-619-9059 网址:www.fundzone.cn (57)

宜信普泽投资顾问(北京)有限公司注册地址:北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809 办公地址:北京市朝阳区建国路 88 号楼 soho 现代城 C 座 18 层 1809 法定代表人:戎兵电话:13520443582 联系人:张得仙客服电话:400-6099-200 网址:www.yixinfund.com (58)

奕丰基金销售有限公司注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1116 室及 1307 室法定代表人:TEO WEE HOWE 电话:13424264100 联系人:叶健客服电话:400-684-0500 网址:www.ifastps.com.cn (59)

北京创金启富投资管理有限公司注册地址:北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A 办公地址:中国北京西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 座综合楼 712 号法定代表人:梁蓉电话:010-66154828-8047 联系人:王瑶客服电话:400-626-2818 网址:www.5irich.com (60)

北京格上富信基金销售有限公司注册地址:北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 03 室办公地址:北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 03 室法定代表人:安立欣电话:15600355787 联系人:张林客服电话:400-080-5828 网址:www.licai.com (61)

上海大智慧财富管理有限公司注册地址:中国(上海)自由贸易试验区郭守敬路 498 号浦东软件园 14 幢 22301-130 座办公地址:上海市杨高南路 428 号由世纪广场 1 号楼法定代表人:张长虹电话:18901685505 联系人:施燕华客服电话:021-20219997 网址:www.gw.com.cn (62)

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:竇玉明电话:021-68609600 联系人:屠帅颖客服电话:400-700-9700 网址:www.zofund.com (63)

上海基煜基金销售有限公司注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)办公地址:上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503-1504 室法定代表人:王翔电话:17721005485 联系人:吴鸿飞客服电话:400-820-5369 网址:www.jiyufund.com.cn (64)

凤凰金信(银川)基金销售有限公司注册地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402 办公地址:朝阳区来广营中街甲 1 号朝来高科技产业园 5 号楼法定代表人:程刚电话:18701236910 联系人:陈旭客服电话:400-810-5919 网址:www.fengfd.com (65)

乾道盈泰基金销售(北京)有限公司注册地址:北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室法定代表人:王兴吉联系人:刘金佩电话:15901073209 客服:400-088-8080 网址:www.qiandaojr.com (66)

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 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 传真:0755-26920530 (67)

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 法定代表人:陈继武联系人:高皓辉电话:13861784145 客服:21-6333-3389-230 网址:www.vstonewealth.com (68)

东海期货有限责任公司注册地址:江苏省常州

市延陵西路 23、25、27、29 号办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼法定代表人：陈太康联系人：陶云电话：15527357161 客服：400-8888-588 网址：www.qh168.com.cn (69) 杭州科地瑞富基金销售有限公司注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼法定代表人：陈刚电话：15925665590 联系人：张丽琼客服电话：0571-86655920 网址：www.cd121.com (70) 深圳盈信基金销售有限公司注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1 办公地址：大连市中山区南山路 155 号南山 1910-A3-1 法定代表人：苗宏升联系人：王清臣电话：13522300698 客服：4007-903-688 网址：www.fundying.com (71) 江西正融资产管理有限公司注册地址：江西省南昌市高新区紫阳大道绿地新都会 38 栋 2107 室办公地址：江西省南昌市高新区紫阳大道 3333 号绿地新都会 38 栋 2108 室法定代表人：陆雯联系人：傅翌乔电话：13879129841 客服：0791-86692560 网址：www.jxzrzg.com.cn (72) 上海朝阳永续基金销售有限公司注册地址：上海市浦东新区张江碧波路 690 号 4 号楼 2 楼办公地址：上海市浦东新区张江碧波路 690 号 4 号楼 2 楼法定代表人：廖冰联系人：陆纪青电话：15902135304 客服：400-998-7172 网址：www.998fund.com (73) 嘉晟瑞信(天津)基金销售有限公司注册地址：天津市南开区南门外大街与服装街交口悦府广场 1 号楼 2503 室办公地址：天津市南开区南门外大街与服装街交口悦府广场 1 号楼 2503 室法定代表人：孙伟电话：15510846151 联系人：孙颖客服：400-883-2993 网址：www.jsrxfund.com (74) 南京苏宁基金销售有限公司注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号法定代表人：刘汉青电话：025-66996699-887226 联系人：王锋客服：95177 网址：www.sujijin.com (75) 上海挖财基金销售有限公司注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 700 号 5 层 01、02、03 室办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 5 层法定代表人：胡燕亮电话：021-50810687 联系人：李娟客服：400-025-6569 网址：wacaijijin.com (76) 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 (77) 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 (78) 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 (79) 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：010-88066632 联系人：仲秋玥客服电话：400-817-5666 网址：www.amcfortune.com (80) 和耕传承基金销售有限公司注册地址：郑州市郑东新区东风东路由、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 (81) 通华财富(上海)基金销售有限公司注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融大厦广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼法定代表人：马刚电话：021-60810586 联系人：杨涛客服电话：95156 网址：www.tonghuafund.com (82) 大连网金基金销售有限公司注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室法定代表人：樊怀东电话：0411-39027808 联系人：贾伟刚客服电话：4000-899-100 网址：www.yibaijin.com (83) 长沙银行股份有限公司注册地址：长沙市岳麓区滨江路 53 号凯林商务中心 B 座 办公地址：长沙市岳麓区滨江路 53 号凯林商务中心 B 座法定代表人：朱玉国电话：0731-89736250 联系人：于立娜客户服务热线：40067-96511 网站：www.bankofchangsha.com (84) 珠海华润银行股份有限公司注册地址：广东省珠海市吉大九州大道中 1346 号珠海华润银行大厦办公地址：广东省珠海市吉大九州大道中 1346 号珠海华润银行大厦法定代表人：刘晓勇电话：0756-8121844 传真：0756-8121987 联系人：陈天翔客户服务热线：0756-96588 网站：www.crbank.com.cn (85) 广东顺德农商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：陈素莹电话：0757-22385879
邮编：528300 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，并及时公告。

(二) 注册登记机构名称：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：井贤栋电话：(022) 83865560 传真：(022) 83865563 联系人：薄贺龙 (三) 出具法律意见书的律师事务所名称：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、孙睿联系人：孙睿 (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：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：天弘中证银行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。

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，以中证银行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上市的股票）、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%，投资于中证银行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银行指

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%，投资于中证银行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%，投资于中证银行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银行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: 中证银行指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。中证银行指数由中证全指指数成份中归属于银行二级行业的全部股票组成, 反映了沪深 A 股市场中银行业股票的整体表现, 并为指数化产品提供新的标的指数。如果指数编制单位变更或停止中证银行指数的编制、发布或授权, 或中证银行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银行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, 属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种, 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。基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2019 年 1 月 24 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 2018 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 2018 年第 4 季度报告。

1 报告期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号 项目 金额 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 441,294,631.61 91.70

其中: 股票 441,294,631.61 91.70

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 34,714,258.70 7.21

8 其他资产 5,204,096.57 1.08

9 合计 481,212,986.88 100.00

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）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	—	—
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	—	—
J	金融业	441,178,446.31	93.11
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	—	—
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	441,178,446.31	93.11

2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	66,039.50	0.01
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	—	—
J	金融业	50,145.80	0.01
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	—	—
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 116,185.30 0.02

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 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

金额单位：人民币元

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	600036	招商银行	2,497,193	62,929,263.60	13.28
---	--------	------	-----------	---------------	-------

2	601166	兴业银行	3,125,986	46,702,230.84	9.86
---	--------	------	-----------	---------------	------

3	601328	交通银行	6,891,706	39,902,977.74	8.42
---	--------	------	-----------	---------------	------

4	600016	民生银行	6,386,136	36,592,559.28	7.72
---	--------	------	-----------	---------------	------

5	601288	农业银行	9,612,876	34,606,353.60	7.30
---	--------	------	-----------	---------------	------

6	600000	浦发银行	2,943,686	28,848,122.80	6.09
---	--------	------	-----------	---------------	------

7	601398	工商银行	5,413,891	28,639,483.39	6.04
---	--------	------	-----------	---------------	------

8	601169	北京银行	3,712,149	20,825,155.89	4.40
---	--------	------	-----------	---------------	------

9	000001	平安银行	2,153,385	20,198,751.30	4.26
---	--------	------	-----------	---------------	------

10	601988	中国银行	5,287,721	19,088,672.81	4.03
----	--------	------	-----------	---------------	------

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

金额单位：人民币元

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	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.01
---	--------	------	-------	-----------	------

2	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	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

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

金额单位：人民币元

序号 名称 金额

1 存出保证金 489,733.56

2 应收证券清算款 0.00

3 应收股利 —

4 应收利息 18,638.08

5 应收申购款 4,695,724.93

6 其他应收款 —

7 待摊费用 —

8 其他 —

9 合计 5,204,096.57

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

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 601860 紫金银行 50,145.80 0.01 新股未上市

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 07 月 08 日，基金业绩数据截至 2018 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

中证银行 A

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④

①-③ ②-④

2015/07/08-2015/12/31 -2.34% 2.12% -11.84% 2.21% 9.50% -0.09%

2016/01/01-2016/12/31 -2.60% 0.95% -4.06% 0.95% 1.46% 0.00%

2017/01/01-2017/12/31 18.08% 0.79% 13.67% 0.79% 4.41% 0.00%

2018/01/01-2018/12/31 -12.15% 1.22% -13.91% 1.23% 1.76% -0.01%

基金合同生效日(2015/07/08)-2018/12/31 -1.33% 1.22% -17.23% 1.25% 15.90% -0.03%

中证银行 C

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④

①-③ ②-④

2015/07/08-2015/12/31 -2.50% 2.12% -11.84% 2.21% 9.34% -0.09%

2016/01/01-2016/12/31 -2.86% 0.95% -4.06% 0.95% 1.20% 0.00%

2017/01/01-2017/12/31 17.79% 0.79% 13.67% 0.79% 4.12% 0.00%

2018/01/01-2018/12/31 -12.34% 1.22% -13.91% 1.23% 1.57% -0.01%

基金合同生效日(2015/07/08)-2018/12/31 -2.21% 1.22% -17.23% 1.25% 15.02% -0.03%

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： $H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$ 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、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： $H=E \times \text{销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$ 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，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、休息日，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： $H=E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$ 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”，由基金管理人和基金托管人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，由基金托管人根据基金管理人的指令从基金财产中支付。

(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项纳税主体，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》、《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 2018 年 8 月 21 日公告的《天弘中证银行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“二十二、对基金份额持有人的服务”的相关内容；

8、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。

天弘基金管理有限公司

二〇一九年二月二十一日