（上接B231版）

联系人：张晓晨
客户服务热线：400-800-8899
网址：www.cindasc.com
（91）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：021-22169999
传真：021-22169134
联系人：姚巍
客户服务热线：95525
网址：www.ebscn.com
（92）新时代证券有限责任公司
住所：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
（93）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：0351-7219303
联系人：张冠
客户服务热线：400-712-1212
网址：www.dtsbc.com.cn
（94）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：0755-22626391
传真：0755-82400862
联系人：周驰
客户服务热线：95511-8
网址：stock.pingan.com
（95）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
（96）西藏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
（97）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
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）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）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：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：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：天弘沪深300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，以沪深300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%，投资于沪深300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沪深300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%，投资于沪深300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%，投资于沪深300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沪深300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：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

沪深300指数是由中证指数有限公司编制，上海证券交易所和深圳证券交易所于2005年4月8日联合发布的反映A股市场整体走势的指数。沪深300指数编制的目标是反映中国证券市场股票价格变动的概貌和运行状况，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沪深300指数的编制、发布或授权，或沪深300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沪深300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8月6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2019年6月30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2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	3,272,488,951.53	93.54
	其中：股票	3,272,488,951.53	93.54
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	199,546,875.86	5.70
8	其他资产	26,389,283.06	0.75
9	合计	3,498,425,110.45	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	48,145,792.60	1.39
B	采矿业	105,193,795.58	3.04
C	制造业	1,300,261,484.87	37.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	74,205,307.92	2.15
E	建筑业	99,215,755.55	2.87
F	批发和零售业	44,600,958.83	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	100,320,656.79	2.90
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,472,915.98	3.43
J	金融业	1,147,399,177.07	33.19
K	房地产业	149,233,336.41	4.32
L	租赁和商务服务业	45,932,139.60	1.33
M	科学研究和技术服务业	2,383,700.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	3,885,901.28	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	16,281,982.56	0.47
R	文化、体育和娱乐业	15,414,167.10	0.45
S	综合	—	—
	合计	3,270,947,072.14	94.61

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	363,431.25	0.01
C	制造业	1,081,867.84	0.03
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	39,603.76	0.00
J	金融业	33,869.94	0.00
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	23,106.60	0.00
S	综合	—	—
	合计	1,541,879.39	0.04

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票中，信威集团（证券代码：600485）被调出成份股后停牌，故以积极投资股票列示（下同）。

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	601318	中国平安	2,859,270	253,359,914.70	7.33
2	600519	贵州茅台	132,717	130,593,528.00	3.78
3	600036	招商银行	2,722,596	97,959,004.08	2.83
4	601166	兴业银行	3,838,300	70,202,507.00	2.03
5	000651	格力电器	1,270,276	69,865,180.00	2.02
6	000333	美的集团	1,220,514	63,295,856.04	1.83
7	000858	五 粮 液	512,267	60,421,892.65	1.75
8	600276	恒瑞医药	817,167	53,933,022.00	1.56
9	600887	伊利股份	1,609,329	53,767,681.89	1.56
10	600030	中信证券	2,077,455	49,464,203.55	1.43

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	600485	*ST信威	144,102	904,960.56	0.03
2	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.01
3	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
4	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
5	603863	松炀资源	1,612	37,204.96	0.00

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

公允价值变动总额合计（元）	-
股指期货投资本期收益（元）	145,456.31
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-

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	1,687,031.75
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	99,828.93
5	应收申购款	24,602,422.38
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	26,389,283.06

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	600485	*ST信威	904,960.56	0.03	重大资产重组

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1月20日，基金业绩数据截至2019年6月30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

沪深300A

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
2015/01/20-2015/12/31	7.08%	2.39%	11.01%	2.35%	-3.93%	0.04%
2016/01/01-2016/12/31	-9.71%	1.36%	-10.63%	1.33%	0.92%	0.03%
2017/01/01-2017/12/31	21.92%	0.60%	20.63%	0.60%	1.29%	0.00%
2018/01/01-2018/12/31	-22.61%	1.26%	-24.12%	1.27%	1.51%	-0.01%
2019/01/01-2019/06/30	26.73%	1.47%	25.65%	1.47%	1.08%	0.00%
自基金合同生效日（2015/01/20）-2019/06/30	15.60%	1.52%	14.12%	1.50%	1.48%	0.02%

沪深300C

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
2018/04/25-2018/12/31	-19.00%	1.33%	-20.63%	1.34%	1.63%	-0.01%
2019/01/01-2019/06/30	26.60%	1.47%	25.65%	1.47%	0.95%	0.00%
自C类基金份额首次确认日（2018/04/25）-2019/06/30	2.55%	1.39%	-0.27%	1.40%	2.82%	-0.01%

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，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》、《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3月5日公告的《天弘沪深300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。

天弘基金管理有限公司
二〇一九年八月三十一日

证券代码：603603 证券简称：博天环境 公告编号：临2019-110
债券代码：136749 债券简称：G16博天
债券代码：150049 债券简称：17博天01

博天环境集团股份有限公司 2019年第五次临时股东大会决议公告

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：

● 本次会议是否有否决议案：无

一、会议召开和出席情况

(一) 股东大会召开的时间：2019年8月30日

(二) 股东大会召开的地点：北京市东城区安定门外大街208号中粮置地广场9层北区精进轩会议室

(三) 出席会议的普通股股东和恢复表决权的优先股股东及其持有股份情况：

1、出席会议的股东和代理人人数	6
2、出席会议的股东所持有表决权的股份总数（股）	263,358,055
3、出席会议的股东所持有表决权股份数占公司有表决权股份总数的比例（%）	63.0369

(四) 表决方式是否符合《公司法》及《公司章程》的规定，大会主持情况等。

本次股东大会由公司董事会召集，由副董事长张蕾女士主持，会议采用现场投票和网络投票相结合的方式召开，会议的召集、召开和表决方式符合《公司法》及《公司章程》的有关规定。

(五) 公司董事、监事和董事会秘书的出席情况

1、公司在任董事7人，出席7人，全部董事均出席了本次会议；

2、公司在任监事5人，出席5人，全部监事均出席了本次会议；

3、董事会秘书刘世博出席了本次会议；部分高级管理人员列席本次会议。

二、议案审议情况

(一) 非累积投票议案

1、议案名称：《关于公司拟发行定向融资计划并提供反担保的议案》

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
A股	263,357,055	99.9996	1,000	0.0004	0	0

2、议案名称：《关于公司拟对外提供担保的议案》

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
A股	263,357,055	99.9996	1,000	0.0004	0	0

(二) 涉及重大事项，5%以下股东的表决情况

议案序号	议案名称	同意		反对		弃权	
		票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
1	《关于公司拟发行定向融资计划并提供反担保的议案》	16,932,007	99.9940	1,000	0.0060	0	0
2	《关于公司拟对外提供担保的议案》	16,932,007	99.9940	1,000	0.0060	0	0

(三) 关于议案表决的有关情况说明

本次会议共审议两项议案且均为特别决议事项，经出席本次会议有表决权的股东所持表决权的三分之二以上表决通过。

三、律师见证情况

1、本次股东大会见证的律师事务所：北京市奋迅律师事务所

律师：杨颖菲、翁文涛

2、律师见证结论意见：

公司本次股东大会的召集、召开程序符合《公司法》、《规则》等有关法律、行政法规、规范性文件及公司章程的规定，本次股东大会的召集人及出席或列席会议人员的资格合法有效，表决程序合法，所通过的决议合法有效。

四、备查文件目录

1、博天环境集团股份有限公司2019年第五次临时股东大会决议；

2、 北京市奋迅律师事务所关于博天环境集团股份有限公司2019年第五次临时股东大会有关事宜的法律意见书。

博天环境集团股份有限公司
2019年8月31日

证券代码：603603 证券简称：博天环境 公告编号：临2019-111
债券代码：136749 债券简称：G16博天
债券代码：150049 债券简称：17博天01

博天环境集团股份有限公司 关于仲裁进展公告

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。

博天环境集团股份有限公司（以下简称“公司”或“博天环境”）于2019年8月29日收到北京仲裁委员会（北京国际仲裁中心）签发的《关于（2019）京仲裁字第2408号仲裁案开庭通知》（以下简称“《开庭通知》”），现将有关事项公告如下：

一、本次仲裁基本情况

公司于2019年8月19日披露了《博天环境集团股份有限公司关于公司涉及仲裁事项的公告》，申请人许又志、王霞、王晓就公司收购高频美特利环境科技（北京）有限公司70%股权事宜向北京仲裁委员会提出仲裁申请，请求解除《发行股份及支付现金购买资产协议》等收购协议。具体内容详见公司于2019年8月19日在上海证券交易所网站（http://www.sse.com.cn）刊登的相关公告。

二、本次仲裁进展情况

公司于2019年8月29日收到北京仲裁委签发的《开庭通知》，主要内容为：关于申请人许又志、王霞、王晓与被申请人博天环境之间因《发行股份及支付现金购买资产协议》所引起的争议仲裁案，本案仲裁庭决定于2019年10月15日在北京仲裁委员会开庭审理。

公司将按照相关规定对该仲裁事项的后续进展情况及时进行披露。公司指定的信息披露媒体为《中国证券报》《上海证券报》《证券日报》《证券时报》及上海证券交易所网站（www.sse.com.cn），有关信息请以上述指定媒体刊登的信息为准。敬请广大投资者注意投资风险。

三、备查文件

1、《关于（2019）京仲裁字第2408号仲裁案开庭通知》。

特此公告。

博天环境集团股份有限公司董事会
2019年8月31日

证券代码：601880 证券简称：大连港 公告编号：临2019—036

大连港股份有限公司关于公司间接控股股东国有股权无偿划转获得中国证监会核准豁免要约收购义务批复的公告

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。

2019年5月31日，辽宁省人民政府国有资产监督管理委员会与招商局（辽宁）港口发展有限公司（以下简称“招商局辽宁”）签署了《关于辽宁港口集团有限公司之股权无偿划转协议》（以下简称“无偿划转协议”），辽宁省人民政府国有资产监督管理委员会拟将其持有的辽宁港口集团有限公司（即公司间接控股股东）1.1%的股权无偿划转给招商局辽宁（以下简称“本次划转”）。具体内容详见公司于2019年6月3日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）的《大连港股份有限公司关于公司间接控股股东股权划转暨公司实际控制人拟发生变更的提示性公告》（公告编号：临2019-023）。

2019年8月30日，公司收到控股股东大连港集团有限公司发来的通知，招商局辽宁收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于核准豁免招商局（辽宁）港口发展有限公司及其一致行动人要约收购大连港股份有限公司股份义务的批复》（证监许可[2019]1545号）以及《关于核准豁免招商局（辽宁）港口发展有限公司及其一致行动人要约收购营口港务股份有限公司股份义务的批复》（证监许可[2019] 1546号）。批复主要内容如下：核准豁免招商局辽宁及其一致行动人因国有资产行政划转而控制大连港股份有限公司5,378,564,752股A股股份和722,166,000股H股股份，导致合计控制该公司5,378,564,752股A股股份和3,436,902,000股H股股份，约占该公司总股本的68.37%而应履行的要约收购义务。核准豁免招商局辽宁及其一致行动人因国有资产行政划转而控制营口港务股份有限公司5,067,415,378股股份，约占该公司总股本的78.29%而应履行的要约收购义务。招商局辽宁及其一致行动人应当按照有关规定及时履行信息披露义务。招商局辽宁及其一致行动人应当会同大连港股份有限公司、营口港务股份有限公司按照有关规定办理相关手续。招商局辽宁及其一致行动人在实施过程中，如发生法律、法规要求披露的重大事项或遇重大问题，应当及时报告中国证监会。

至此，无偿划转协议下的生效条件均已获满足，无偿划转协议已生效。在无偿划转协议下的交割先决条件满足（或被相关方豁免）后，相关方将根据无偿划转协议安排办理本次划转的工商变更登记手续。

公司后续将根据本次划转进展情况，及时履行信息披露义务。

特此公告。

大连港股份有限公司董事会
2019年8月30日

证券代码：603168 证券简称：莎普爱思 公告编号：临2019-049

浙江莎普爱思药业股份有限公司 关于收购强身药业100%股权所涉2018年度业绩承诺补偿事项的进展公告

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。

一、关于收购强身药业100%股权所涉业绩承诺情况

浙江莎普爱思药业股份有限公司（以下简称“本公司”、“公司”）于2015年11月12日召开的第三届董事会第五次会议和2015年12月1日召开的2015年第一次临时股东大会，分别审议通过了公司与吉林省东丰药业股份有限公司（以下简称“东丰药业”）及刘宪彬签署的《附生效条件的股权转让协议》（以下简称“股权转让协议”），公司拟以非公开发行股票及支付现金方式收购吉林强身药业有限责任公司（现已更名为“莎普爱思强身药业有限公司”，以下简称“强身药业”）100%股权。2016年11月17日公司收到中国证监会《关于核准浙江莎普爱思药业股份有限公司非公开发行股票的批复》（证监许可【2016】2580号），公司对东丰药业非公开发行的274.73万股股份已于2016年12月15日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理完毕股份登记托管手续。上述详细内容请见本公司在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的相关公告。

根据《股权转让协议》的相关约定，东丰药业承诺强身药业2016年度、2017年度和2018年度净利润(指净利润与当年实现的扣除非经常性损益后的净利润孰低者，下同)，分别不低于1,000万元、3,000万元和5,000万元。如强身药业2016年度、2017年度和2018年度实际实现的净利润低于前述承诺净利润，差额部分由东丰药业以现金补足，东丰药业实际控制人刘宪彬就东丰药业的现金补足义务承担连带责任。

二、强身药业2018年度业绩承诺实现情况及拟补偿相关情况

公司于2019年4月25日召开的第四届董事会第五次会议审议通过《关于收购强身药业100%股权所涉业绩承诺2018年度实现情况及资产转让方拟对公司进行业绩补偿的议案》：鉴于强身药业2018年度业绩承诺未实现，根据《股权转让协议》的相关约定，东丰药业和刘宪彬将以现金方式补偿业绩差额部分5,802.31万元。东丰药业及刘宪彬于2019年4月25日出具《承诺函》承诺：将于2019年12月31日前支付业绩承诺补偿款；刘宪彬就该等业绩补偿款支付承担连带责任。上述详细内容请见本公司于2019年4月27日在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的《莎普爱思关于收购强身药业100%股权所涉业绩承诺2018年度实现情况及资产转让方拟对公司进行业绩补偿的公告》（公告编号：临2019-022）。上述事项已经公司于2019年5月22日召开的2018年年度股东大会审议通过。

三、截至本公告日，强身药业2018年度业绩承诺补偿事项相关进展

（一）本次收到的业绩承诺补偿款相关情况

2019年8月30日，公司收到东丰药业支付的强身药业2018年业绩承诺补偿款550万元（其中银行承兑汇票400万元），计入“营业外收入”科目。

截至2019年8月30日，公司已累计收到东丰药业支付的强身药业2018年度业绩补偿款1,650.4万元，尚有4,151.91万元未支付；根据相关承诺，东丰药业将于2019年12月31日前完成支付。

（二）其他已收到的业绩承诺补偿款相关情况

1、2019年5月15日，公司收到东丰药业支付的强身药业2018年业绩承诺补偿款500万元（其中银行承兑汇票300万元），计入“营业外收入”科目。上述详细内容请见本公司于2019年5月16日在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的《关于收购强身药业100%股权所涉2018年度业绩承诺补偿事项的进展公告》（公告编号：临2019-031）。

2、2019年6月20日，公司收到东丰药业支付的强身药业2018年业绩承诺补偿款300.4万元（银行承兑汇票），计入“营业外收入”科目。上述详细内容请见本公司于2019年6月21日在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的《关于收购强身药业100%股权所涉2018年度业绩承诺补偿事项的进展公告》（公告编号：临2019-036）。

3、2019年7月30日，公司收到东丰药业支付的强身药业2018年业绩承诺补偿款300万元（其中银行承兑汇票260万元），计入“营业外收入”科目。上述详细内容请见本公司于2019年7月31日在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的《关于收购强身药业100%股权所涉2018年度业绩承诺补偿事项的进展公告》（公告编号：临2019-039）。

为保护公司及全体股东权益，公司将持续督促东丰药业尽快支付全部业绩承诺补偿款，并根据东丰药业承诺履行情况，及时披露相关进展情况。公司指定的信息披露媒体为《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和上海证券交易所网站（www.sse.com.cn），有关公司信息均以在上述指定媒体刊登的公告为准。

特此公告。

浙江莎普爱思药业股份有限公司
董事会
2019年8月31日

证券代码：603356 证券简称：华菱精工 公告编号：2019-061

宣城市华菱精工科技股份有限公司高管减持股份进展公告

本公司董事会、全体董事及相关股东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：

● 高管持股的基本情况

宣城市华菱精工科技股份有限公司(以下简称“公司”) 财务总监张永林先生在减持计划实施前持有公司200,000股，占公司总股本的0.15%。该股份来源为公司首次公开发行前取得的股份，且已于2019年1月25日解除限售并上市流通。

● 减持计划的进展情况

张永林先生计划以集中竞价或大宗交易方式减持公司股份，预计减持数量合计不超过50,000 股，即不超过公司总股本的0.0375%。具体详见公司于2019年5月7日披露的《宣城市华菱精工科技股份有限公司高管减持股份计划公告》（公告编号：2019-031）。

截止本公告披露日，本次减持计划时间已过半，张永林未减持其股份，减持计划尚未实施完毕。

一、减持主体减持前基本情况

股东名称	股东身份	持股数量（股）	持股比例	当前持股股份来源
张永林	董事、监事、高级管理人员	200,000	0.15%	IPO前取得：200,000股

上述减持主体无一致行动人。

二、减持计划的实施进展

（一）高级管理人员因以下原因披露减持计划实施进展：

减持时间过半

截至本公告披露日，公司股东张永林先生未通过任何方式减持其持有的公司股份。

（二）本次减持事项与高级管理人员此前已披露的计划、承诺是否一致

√是 □否

（三）在减持时间区间内，上市公司是否披露高送转或筹划并购重组等重大事项

□是 √否

（四）本次减持对公司的影响

张永林不属于公司控股股东、实际控制人。本次减持计划实施不会导致公司控制权发生变更，不会对公司治理结构、股权结构及持续性经营产生重大影响。

（五）本所要求的其他事项

公司将继续关注张永林的减持计划后续实施情况，严格遵守有关法律法规，及时履行信息披露义务。

三、相关风险提示

（一）减持计划实施的不确定性风险，如计划实施的前提条件、限制性条件以 及相关条件成就或消除的具体情形等

张永林将根据市场情况、公司股价等具体情形决定是否继续实施后续减持计划，具体实施情况存在一定的不确定性。

（二）减持计划实施是否会导致上市公司控制权发生变更的风险 □是 √否

（三）其他风险

无

特此公告。

宣城市华菱精工科技股份有限公司董事会
2019年8月31日