关于天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告

根据《深圳证券交易所证券投资基金业务指引第2号——流动性服务》等有关规定，自2021年7月20日起，本公司终止招商证券股份有限公司为天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金（场内简称：创业板 TH、代码：159977）提供流动性服务。

特此公告。

天弘基金管理有限公司

二〇二一年七月十九日

关于天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金变更为天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并相应修订基金合同的公告

天弘基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（基金简称“天弘中证全指证券公司”）于2019年10月30日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2019】2056号）。《天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于2019年12月20日正式生效。《基金合同》约定：“若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人有权决定本基金是否采取ETF联接基金模式运作并相应修改《基金合同》，如决定以ETF联接基金模式运作，则届时无须召开基金份额持有人大会但须报中国证监会备案并提前公告。”同时，《基金合同》约定：“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：……（3）若将来本基金管理人推出投资同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式并相应修改基金合同……”

本公司旗下天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金已于2021年1月28日正式成立。为更好的满足投资者的投资需求，本公司经与基金托管人国泰君安证券股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定于2021年7月19日起，将天弘中证全指证券公司变更为天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（基金简称“天弘中证全指证券公司ETF发起式联接”，A类份额基金代码：008590，C类份额基金代码：008591），并引入侧袋机制。根据法律法规及《基金合同》的有关规定，已对《基金合同》、《天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金托管协议》、《天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金招募说明书》及基金产品资料概要进行相应的修订和补充。《基金合同》的修订内容详见附件《〈天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同〉修订对照表》。

届时，天弘中证全指证券公司的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“天弘中证全指证券公司指数A类基金份额”变更为“天弘中证全指证券公司ETF发起式联接A类基金份额”，将“天弘中证全指证券公司指数C类基金份额”变更为“天弘中证全指证券公司ETF发起式联接C类基金份额”。前述变更不影响各类基金份额净值的计算。

基金变更后，各类基金份额的申购费率及赎回费率保持不变，且《基金合同》关于发起资金提供方及发起资金认购份额的规定继续有效。

重要提示

1、修订后的《天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》、《天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》、《天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》自2021年7月19日起生效。

2、变更后的天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金C类基金份额继续参与销售服务费优惠活动，优惠后的销售服务费年费率为0.20%。

3、投资者可登录本公司网站（www.thfund.com.cn）查阅修订后的法律文件，或拨打客户服务电话（95046）获取相关信息。

风险提示：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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书及基金产品资料概要等信息披露文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

天弘基金管理有限公司

二〇二一年七月十九日

附件：《天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》

修订前后对照表

所在部分	修订前	修订后
封面	天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同	天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同 （由天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金转型而来）
全文	指定媒介/指定报刊/指定网站	规定媒介/规定报刊/规定网站
全文	天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金	天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
第一部分 前言	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。 三、天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。 中国证监会对本基金募集的注册，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。 投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，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。 四、本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险，详见本基金招募说明书。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》(以下简称“《民法典》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。 三、天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金变更而来，天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。 中国证监会对天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金的注册及后续转型为本基金的备案，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。 投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，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。 四、本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股及备选成份股，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险，详见本基金招募说明书。
第一部分 前言	八、本基金单一投资者（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理作为发起资金提供方除外）持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。 九、本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。	删除。
第二部分 释义	1、基金或本基金：指天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金	1、基金或本基金：指天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，由天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金变更而来
第二部分 释义	4、基金合同或本基金合同：指《天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充	4、基金合同或本基金合同：指《天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
第二部分 释义	5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充	5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
第二部分 释义	6、招募说明书：指《天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新	6、招募说明书：指《天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》及其更新
第二部分 释义	7、基金产品资料概要：指《天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新	7、基金产品资料概要：指《天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金产品资料概要》及其更新
第二部分 释义	8、基金份额发售公告：指《天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金份额发售公告》	删除。
第二部分 释义	11、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订	10、《销售办法》：指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
第二部分 释义	12、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订	11、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施，并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
第二部分 释义		16、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于目标ETF，与目标ETF的投资目标类似，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用契约型开放式运作方式的基金 17、目标ETF：指另一只获中国证监会注册的交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“该ETF”），该ETF和本基金所跟踪的标的指数相同，并且该ETF的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该ETF以求达到投资目标。本基金选择天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF
第二部分 释义	20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者 21、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人 22、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称	21、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者 22、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
第二部分 释义	24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务	24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
第二部分 释义	29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户	29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
第二部分 释义	30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期	30、基金合同生效日：指天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
第二部分 释义	33、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月	删除。
第二部分 释义	33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限	32、存续期：指《天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》生效至《天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》终止之间的不定期期限
第二部分 释义	40、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为	删除。
第二部分 释义	50、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和	48、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行ETF份额、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
第二部分 释义	54、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介	52、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
第二部分 释义	58、发起资金：指用于认购发起式基金且来源于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员工中依法具有基金经理资格者，包括但可能不限于本基金的基金经理，同时也可以包括基金经理之外公司投研人员）等人员的资金 59、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员工中依法具有基金经理资格者，包括但可能不限于本基金的基金经理，同时也可以包括基金经理之外公司投研人员）等人员	56、发起资金：指用于认购天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金的基金管理人固有资金 57、发起资金提供方：指以发起资金认购天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人 61、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户 62、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产
第三部分 基金的基本情况	一、基金名称 天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金	一、基金名称 天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
第三部分 基金的基本情况	二、基金的类别 股票型证券投资基金	二、基金的类别 ETF联接基金
第三部分 基金的基本情况	四、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。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%。	四、基金的投资目标 通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
第三部分 基金的基本情况	五、基金的最低募集金额 本基金为发起式基金，基金的最低募集金额为1000万元人民币。 发起式基金是指，基金管理人在募集基金时，使用公司股东资金、公司固有资金、公司高级管理人员或者基金经理等人员资金认购基金的金额不少于一千万元人民币，且持有期限不少于三年。发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止。 六、基金份额发售面值和认购费用 本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。 本基金A类基金份额的认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。C类基金份额不收取认购费。	删除。
第三部分 基金的基本情况	九、未来条件许可情况下的基金模式转换 若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人有权决定本基金是否采取ETF联接基金模式运作并相应修改《基金合同》，如决定以ETF联接基金模式运作，则届时无须召开基金份额持有人大会但须报中国证监会备案并提前公告。	删除。
第三部分 基金的基本情况		七、本基金与目标ETF的联系与区别 本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别： 1、在投资方法方面，目标ETF主要采取完全复制法，直接投资于标的指数成份股、备选成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。 2、在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标ETF，也可以按照最小申购赎回单位和申购赎回清单的要求，申赎目标ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及销售机构按“未知价”原则进行基金的申购与赎回。 本基金与目标ETF业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括： 1、法律法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，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、申购赎回的影响。目标ETF 采取按照最小申购赎回单位和申购赎回清单要求进行申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金采取按照未知价法进行申赎的方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。
第三部分 基金的历史沿革与存续	第四部分 基金份额的发售 一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象 1、发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。 2、发售方式 通过各销售机构的基金销售网点或其指定的其他方式公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。 3、发售对象 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。 二、基金份额的认购 1、认购费用 本基金分为A类和C类基金份额。投资人在认购A类基金份额支付认购费用，认购C类基金份额不支付认购费用。 本基金A类基金份额的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。基金认购费用不列入基金财产。 2、募集期利息的处理方式 有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。 3、基金认购份额的计算 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。 4、认购份额余额的处理方式 认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。 5、认购申请的确认 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询。 三、基金份额认购金额的限制 1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。 2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。 3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。 4、投资人在基金募集期内可以多次认购基金份额。认购申请一经受理不得撤销。 5、如本基金单个投资人（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理作为发起资金提供方除外）累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。	第四部分 基金的历史沿革与存续 一、基金的历史沿革 天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金转型而来。天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金经中国证监会《关于准予天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]2056号）准予募集注册，基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金自2019年12月18日至2019年12月18日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》于2019年12月20日生效。 2021年1月28日，基金管理人管理的天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金正式成立。基金管理人根据《天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定，决定将天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金转换为天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，即本基金。 自2021年XX月XX日起，天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金正式转型为联接基金。 二、基金的存续 基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于2亿元的，本基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定即可按照本基金合同约定的程序进行清算，并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。 本基金在基金合同生效三年后继续存续的，基金存续期内，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续五十个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，而无需召开基金份额持有人大会。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。
第十一部分 基金的投资	二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证全指证券公司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）、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、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）。 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。 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： 本基金投资于中证全指证券公司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%；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。	二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以目标ETF基金份额、中证全指证券公司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，含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、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）。 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。 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：本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%；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。
第十一部分 基金的投资	三、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全指证券公司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。本基金投资于中证全指证券公司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%；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中证全指证券公司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%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全指证券公司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、存托凭证投资策略 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。 4、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。 5、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。 6、参与融资及转融通证券出借业务策略 为更好的实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要，参与融资及转融通证券出借业务，本基金将在分析市场行情和组合风险收益的情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定投资时机、出借证券的范围、期限和比例。若相关融资及转融通业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。 7、其他金融工具投资策略 本基金可基于谨慎原则运用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。同时，本基金还将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与股指期货的投资。	三、投资策略 本基金为目标ETF的联接基金，目标ETF 是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。 本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股及备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。 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。 1、目标ETF投资策略 本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF的份额。 2、股票投资策略 基金可投资于标的指数成份股、备选成份股，以更好的跟踪标的指数。同时，还可通过买入标的指数成份股、备选成份股来构建组合以申购目标ETF。因此对标的指数成份股、备选成份股的投资，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。 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、存托凭证投资策略 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。 5、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。 6、参与融资及转融通证券出借业务策略 为更好的实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要，参与融资及转融通证券出借业务，本基金将在分析市场行情和组合风险收益的情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定投资时机、出借证券的范围、期限和比例。若相关融资及转融通业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。 7、其他金融工具投资策略 本基金可基于谨慎原则运用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。同时，本基金还将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与股指期货的投资。
第十一部分 基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资于中证全指证券公司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%； （2）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，保持不低于基金资产净值5%的现金或者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； （3）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%； （4）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%； （5）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%； （6）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%； （7）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； （8）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； （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）本基金总资产不得超过基金净资产的140%； （11）本基金在任何交易日日终，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%； （12）本基金在任何交易日日终，持有的买入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； （13）本基金在任何交易日日终，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%； （14）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股