天弘安益债券型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:南京银行股份有限公司
日期:二〇二〇年四月

重要提示

天弘安益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)于 2019 年 4 月 2 日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可[2019]620 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注册,但中国证监会准予本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益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 2019 年 5 月 14 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,由投资者自行负责。

本基金属于债券型证券投资基金,其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

基金管理人在此特别提示投资者:本基金存在法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述,代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价,不同的销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同,投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

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》、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,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。基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本基金单一投资者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。法律法规或监管部门另有规定的,从其规定。

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。

本招募说明书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。

基金招募说明书每年度至少更新一次,本招募说明书所载内容截止日为 2020 年 3 月 2 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2019 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:胡晓明

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

胡晓明先生,董事长,硕士研究生。曾在中国建设银行及中国光大银行等金融机构任职,2005 年 6 月加入阿里巴巴集团,先后在支付宝、阿里金融、蚂蚁金服担任重要职务。现任蚂蚁金服集团首席执行官。

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,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。现任蚂蚁金服集团副总裁。

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。现任蚂蚁金服集团资深总监。

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,天津国通股权投资基金管理有限公司董事、总经理,天津天信汇金资产管理有限公司董事长(法定代表人)、总经理,中车金租租赁有限公司董事。

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院长。

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、总经理,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,上海君正集能燃气有限公司董事,连云港港口国际石化仓储有限公司董事,上海君正物流有限公司董事,上海思尔博化工物流有限公司董事,上海君正船务有限公司董事,上海傲兴国际船舶管理有限公司监事。

李渊女士,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,现任本公司金融机构部战略客户中心创新业务负责人。

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。

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。

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。

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

姜晓丽女士,经济学硕士,11 年证券从业经验。历任本公司债券研究员兼债券交易员,光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交易员,本公司固定收益研究员,天弘永利债券型证券投资基金基金经理助理、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015 年 6 月至 2017 年 8 月)、天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016 年 12 月至 2018 年 3 月)、天弘瑞利分级债券型证券投资基金基金经理(2015 年 1 月至 2018 年 3 月)、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017 年 5 月至 2018 年 6 月)、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016 年 11 月至 2018 年 8 月)、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016 年 11 月至 2018 年 9 月)、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016 年 12 月至 2018 年 9 月)、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017 年 3 月至 2019 年 4 月)、天弘添利债券型证券投资基金(LOF)基金经理(2018 年 8 月至 2019 年 11 月)、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金基金经理(2013 年 7 月至 2019 年 11 月)、天弘信利债券型证券投资基金基金经理(2016 年 12 月至 2019 年 11 月)、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016 年 1 月至 2019 年 11 月)、天弘悦享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2018 年 5 月至 2019 年 11 月)、天弘弘利债券型证券投资基金基金经理(2017 年 4 月至 2019 年 12 月)、天弘精选混合型证券投资基金基金经理(2016 年 7 月至 2019 年 12 月)、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理(2015 年 4 月至 2019 年 12 月)、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015 年 6 月至 2019 年 12 月)、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2017 年 12 月至 2019 年 12 月)、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015 年 6 月至 2019 年 12 月)。现任固定收益机构投资部部门总经理,天弘永利债券型证券投资基金基金经理、天弘安康颐养混合型证券投资基金基金经理、天弘通利混合型证券投资基金基金经理、天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金基金经理、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、天弘安益债券型证券投资基金基金经理、天弘增强回报债券型证券投资基金基金经理、天弘华享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、天弘信益债券型证券投资基金基金经理、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)基金经理。

赵鼎龙先生,电子学硕士学位,5 年证券从业经验。历任泰康资产管理有限责任公司固收交易员。2017 年 8 月加盟本公司,历任固定收益机构投资部研究员、投资经理助理、基金经理助理。现任天弘安益债券型证券投资基金基金经理、天弘弘利债券型证券投资基金基金经理、天弘华享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘恒享一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

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。

姜晓丽女士:固定收益机构投资部总经理,基金经理。

于洋先生:股票投资研究部总经理助理,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、基本情况

名称:南京银行股份有限公司

住所:南京市中山路 288 号

法定代表人:胡升荣

成立时间:1996 年 2 月 6 日

基金托管业务批准文号:中国证监会证监许可〔2014〕405 号

组织形式:股份有限公司

注册资本:848220.7924 万元人民币

存续期间:持续经营

二、基金托管业务经营情况

(一)托管业务概况

南京银行成立于 1996 年 2 月 8 日,是一家具有由国有股份、中资法人股份、外资股份及众多个人股份共同组成独立法人资格的股份制商业银行,实行一级法人体制。南京银行历经两次更名,先后于 2001 年、2005 年引入国际金融公司和法国巴黎银行入股,在全国城商行中率先启动上市辅导程序并于 2007 年成功上市。目前注册资本为 84.82 亿元,下辖 17 家分行,198 家营业网点,员工总数 9200 余人。

南京银行坚持走差异化、特色化、精细化的发展道路,努力做成中小银行中的一流品牌,将中小企业和个人业务作为战略业务重点推进,丰富业务产品体系,倾力满足中小企业与个人融资需求,业务品牌影响力不断扩大。自 2007 年设立第一家异地分行以来,跨区域经营不断推进,先后设立了泰州、北京、上海、杭州、扬州、无锡、南通、苏州、常州、盐城、南京、镇江、宿迁、连云港、江北新区、徐州、淮安 17 家分行,机构战略布局持续深化。

2014 年 4 月 9 日,南京银行获得证监会和银监会联合批复的证券投资基金托管业务资格。取得资格后,南京银行充分发挥基金公司、资产管理等牌照齐全的优势,持续加强与金融市场、投资银行等业务的条线联动优,托管产品种类不断丰富,目前可以开展公募基金托管、银行理财托管、基金公司专户产品托管、基金子公司专户/专项产品托管、证券公司定向/集合资产管理计划托管、信托计划保管、私募基金托管、保险资金托管等业务。截止到 2019 年 6 月 30 日,南京银行托管产品组合数超过 3100 只,托管规模超 16000 亿。

(二)资产托管部组织架构和人员配置情况

经董事会审议通过,南京银行成立了独立的一级部门 ----资产托管部,下设业务运营部、市场营销部、系统支持部、内控稽核部、综合管理部、研究开发部六个内设部门。

目前,南京银行资产托管部共有 57 人,其中从事会计核算、资金清算、投资监督、信息披露、内控稽核的人员 36 人,市场营销 13 人。相较同期获批基金托管资格的其他银行,南京银行在托管运营上配备较强的人力。

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:胡晓明

电话:(022)83865560

传真:(022)83865563

联系人:司媛

客服电话:95046

(2)天弘基金管理有限公司北京分公司

办公地址:北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 A21

电话:(010)83571789

联系人:周娜

2、其他销售机构:

(1)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:北京市朝阳门内大街 188 号

法定代表人:王常青

电话:010-85156310

联系人:刘芸

客户服务热线:400-8888-108

网址:www.csc108.com

(2)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址:浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 3 幢 5 层 599 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:祖国明

联系人:韩爱彬

客服电话:400-0766-123

网站:www.fund123.cn

(3)南京银行股份有限公司

住所:南京市中山路 288 号

办公地址:南京市中山路 288 号

法定代表人:胡升荣

电话:025-86775305

联系人:赵世光

客户服务热线:95302

网址:www.njcb.com.cn

(4)天津银行股份有限公司

住所:天津市河西区友谊路 15 号

办公地址:天津市河西区友谊路 15 号天津银行个金部 1902(室)

法定代表人:李宗唐

电话:022-28405684

联系人:李岩

客户服务热线:4006-960296

网址:www.bank-of-tianjin.com.cn

(5)中国人寿保险股份有限公司

注册地址:中国北京市西城区金融大街 16 号

办公地址:中国北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人:王滨

电话:010-63631539

联系人:秦泽伟

客服电话:95519

网址:www.e-chinalife.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:胡晓明

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、陈颖华

联系人:陈颖华

(四)审计基金财产的会计师事务所

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: 天弘安益债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:债券型

六、基金的投资目标

本基金在保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资人提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。

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,包括国内依法发行上市的债券(国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货等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。

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:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

八、基金的投资策略

1、债券类属配置策略

本基金将根据对政府债券、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,确定债券类属配置策略,并根据市场变化及时进行调整,从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的类属债券配置比例。

2、久期管理策略本基金将根据对利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。

3、收益率曲线策略本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上,将结合收益率曲线变化的预测,适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合,并进行动态调整。

4、信用债券投资策略

本基金将主要通过买入并持有信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用债券产品,获取票息收益。此外,本基金还将通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断,主动采用信用利差投资策略,获取利差收益。

5、资产支持证券投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估其内在价值。

6、国债期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易,以对冲投资组合的系统性风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

此外,在严格控制风险的前提下,本基金将适度参与回购交易等投资,以增加收益。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,在履行适当程序后,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

九、业绩比较基准

本基金投资组合的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率

十、风险收益特征

本基金为债券型基金,其预期收益和风险高于货币市场基金,但低于股票型基金和混合型基金。

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。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定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 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 2019 年第 4 季度报告。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,665,602,000.00	98.20
	其中:债券	1,665,602,000.00	98.20
	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	2,026,591.50	0.12
8	其他各项资产	28,573,315.40	1.68
9	合计	1,696,201,906.90	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	92,650,000.00	6.63
	其中:政策性金融债	92,650,000.00	6.63
4	企业债券	298,462,000.00	21.34
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,274,490,000.00	91.14
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,665,602,000.00	119.11

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101800773	18 首钢	600,000	61,380,000.00	4.39
2	101800865	18 东南国资 MTN002	600,000	61,122,000.00	4.37
3	101778001	17 吉林高速 MTN002	500,000	52,025,000.00	3.72
4	101800270	18 津城建	500,000	51,615,000.00	3.69
5	143709	18 诚通 01	500,000	50,950,000.00	3.64

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 本基金本报告期未持有股票,故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	50,477.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,522,837.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	28,573,315.40

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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。

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 2019 年 05 月 14 日,基金业绩数据截至 2019 年 12 月 31 日。

天弘安益 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2019 年 05 月 14 日-2019 年 12 月 31 日	2.04%	0.03%	1.39%	0.04%	0.65%	-0.01%
自基金合同生效日-2019 年 12 月 31 日	2.04%	0.03%	1.39%	0.04%	0.65%	-0.01%

天弘安益 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2019 年 05 月 14 日-2019 年 12 月 31	1.82%	0.03%	1.39%	0.04%	0.43%	-0.01%
自基金合同生效日-2019 年 12 月 31	1.82%	0.03%	1.39%	0.04%	0.43%	-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、《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、仲裁费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券/期货交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金相关账户的开户费用及维护费用;

10、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 0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.30%÷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

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式根据基金管理人指令于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷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

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式根据基金管理人指令于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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 0.3%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.3%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.3%÷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,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式根据基金管理人指令于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,再由基金管理人代付给各基金销售机构。若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

上述“(一)基金费用的种类”中第 4-10 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《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《流动性管理规定》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 11 月 19 日公告的《天弘安益债券型证券投资基金》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、新增了“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、新增了“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、新增了“二十三、其他应披露的事项”,披露了自上次内容更新截止日至本次内容更新截止日期间涉及本基金及基金管理人的相关公告。

8、本招募说明书依据《信息披露办法》修订的其他内容。

天弘基金管理有限公司
二〇二〇年四月二十一日

证券代码:600671　　证券简称:天目药业　　公告编号:临 2020-020

杭州天目山药业股份有限公司关于延期披露 2019 年经审计年度报告的公告

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。

重要内容提示:

2019 年经审计年度报告原预计披露日期为 2020 年 4 月 30 日

2019 年经审计年度报告延期后的披露日期 2020 年 6 月 12 日

一、审议程序情况

杭州天目山药业股份有限公司(以下简称“公司”或“天目药业”)于 2020 年 4 月 20 日召开第十届董事会第十四次会议,会议以通讯表决方式召开。会议通知通过邮件、信息平台、专人送达、电话等方式通知董事,本次会议应表决董事 9 名,实际参与表决董事 9 名,会议参与表决人数及召集、召开程序符合《公司法》和《公司章程》的有关规定,合法有效。经与会董事表决,会议审议并通过了《关于延期披露 2019 年经审计年度报告的议案》。

董事会认为,公司本次延期披露 2019 年经审计年度报告,是因受到新冠肺炎疫情的影响,公司聘请的会计师事务所审计团队中项目合伙人、主要负责人以及部分项目组成员均来自湖北武汉地区,根据各地各级政府疫情防控的需要,审计人员无法如期进场正常开展审计工作,无法按原计划在 2020 年 4 月 30 日之前出具审计报告,导致公司无法在 2020 年 4 月 30 日披露 2019 年经审计年度报告,属于不可抗力因素。根据中国证监委《关于做好当前上市公司等年度报告审计与披露工作有关事项的公告》及上海证券交易所《关于支持上市公司做好 2019 年年度报告披露工作的通知》文件精神,为确保公司 2019 年年度报告的准确、完整,同意延期至 2020 年 6 月 12 日披露 2019 年经审计年度报告。

二、延期披露说明

(一)无法按期披露的原因

1、公司于 2019 年 12 月 30 日召开 2019 年第五次临时股东大会,审议通过了《关于变更会计师事务所的议案》,公司聘请的年审会计师事务所由原来的瑞华会计师事务所变更为中天运会计师事务所。一方面,由于中天运会计师事务所本年度首次承接公司的财务和内控审计业务,审计人员需要花费更多的时间深入了解公司的具体情况,特别是需要对公司 2018 年度经营情况进行比较全面核查、了解,对 2018 年的关键审计事项进行询证,极大地增加了工作量;另一方面,双方于 2020 年 1 月 15 日正式签署审计业务约定书,时间已临近春节,中天运会计师事务所未能及时安排足够的审计人员来公司进行充分的预审,时间紧、任务重,未能预留出足够可以缓冲的时间,对后续正式审计造成了一定的影响。

2、根据各地各级政府疫情防控需要,公司聘