

# 天弘上证科创板100指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

**重要提示**

1、天弘上证科创板100指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)已获中国证监会2024年4月16日证监许可【2024】590号文准予注册募集。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金的基金管理人和登记机构为天弘基金管理有限公司(以下简称“本公司”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

3、本基金类型为股票型证券投资基金。基金运作方式为契约型开放式、发起式。

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满三年之日(指自然日),若基金资产净值低于两亿元的,基金合同自动终止。

4、本基金将基金份额分为A类和C类不同的类别。A类份额在投资人认购、申购基金时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费;C类基金份额在投资人认购、申购基金时不收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并从本类别基金资产中计提销售服务费。

5、本基金通过本公司直销机构(含直销中心和网上直销系统)和其他销售机构公开发售。

6、本基金的发售期为2024年5月6日至2024年5月10日。

7、投资者欲认购本基金,须开立本公司基金账户,已经有该类账户的投资者不须另行开户。

8、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。

9、基金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。认购申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

10、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请仔细阅读披露在本公司网站([www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn))及中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csirc.gov.cn/fund>)的《天弘上证科创板100指数增强型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘上证科创板100指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》。

11、在募集期间,如出现增加发售机构的情形,本公司将及时披露基金销售机构名单或在官网列示。

12、本公司可综合各种情况对本基金的发售安排做适当调整,并可根据基金销售情况适当延长、缩短或调整基金发售时间,并及时公告。

**13、风险提示:**

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)基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书和基金产品资料概要等信息披露文件,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的风险等。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。

本基金为股票指数增强型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

本基金标的指数为上证科创板100指数,编制方案如下:

(1) 样本空间

指数样本空间由满足以下条件的科创板上市的股票和红筹企业发行的存托凭证组成:

1) 上市时间超过6个月;

2) 非退市风险警示证券;

(2) 选择方法

1) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券,剔除科创50指数样本以及过去一年日均总市值排名样本前40名的证券作为待选样本;

2) 对待选样本按照过去一年的日均总市值由高到低排名,选取排名在100名之前的证券作为指数样本。

(3) 指数计算

上证科创板100指数的计算公式为:

报告期指数=报告期样本的调整市值/除数×1000

其中,调整市值 =  $\Sigma$ (证券价格 × 调整股本数 × 权重因子)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于0和1之间,以使单个样本权重不超过10%,前五大样本权重合计不超过40%。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站,网址:<http://www.csindex.com.cn>。

本基金可投资存托凭证,基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响,存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

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“风险揭示”章节的内容。

本基金主要投资于标的指数的成份股和备选股。如指数成份股发生明显负面事件面临退市或违约风险时,可能在一定时间后被剔除指数成份股,或由于尚未达到指数剔除标准,仍存在于指数成份股中。为充分维护基金份额持有人的利益,针对前述风险证券,基金管理人有权降低配置比例或全部卖出,或进行合理估值调整,从而可能造成与标的之间的跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

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识别。

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等人员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额的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等基金管理人无法予以控制的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。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,基金管理人履行相应程序后,可以启用侧袋机制,具体详见基金合同和本招募说明书的相关章节。侧袋机制实施期间,基金管理人将对基金简称进行特殊标识,并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

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,但不保证投资于本基金一定盈利,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。

**一、基金募集基本情况****(一) 基金名称及代码**

基金名称:天弘上证科创板100指数增强型发起式证券投资基金

基金简称及代码:

天弘上证科创板100指数增强发起A:021385

天弘上证科创板100指数增强发起C:021386

**(二) 基金类型**

股票型证券投资基金

**(三) 基金运作方式**

契约型开放式、发起式。

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满三年之日(指自然日),若基金资产净值低于两亿元的,基金合同自动终止。

4、本基金将基金份额分为A类和C类不同的类别。A类份额在投资人认购、申购基金时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费;C类基金份额在投资人认购、申购基金时不收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并从本类别基金资产中计提销售服务费。

5、本基金通过本公司直销机构(含直销中心和网上直销系统)和其他销售机构公开发售。

6、本基金的发售期为2024年5月6日至2024年5月10日。

7、投资者欲认购本基金,须开立本公司基金账户,已经有该类账户的投资者不须另行开户。

8、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。

9、基金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。认购申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

10、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请仔细阅读披露在本公司网站([www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn))及中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csirc.gov.cn/fund>)的《天弘上证科创板100指数增强型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘上证科创板100指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》。

11、在募集期间,如出现增加发售机构的情形,本公司将及时披露基金销售机构名单或在官网列示。

12、本公司可综合各种情况对本基金的发售安排做适当调整,并可根据基金销售情况适当延长、缩短或调整基金发售时间,并及时公告。

13、风险提示:

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)基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书和基金产品资料概要等信息披露文件,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的风险等。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。

本基金为股票指数增强型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

本基金标的指数为上证科创板100指数,编制方案如下:

(1) 样本空间

指数样本空间由满足以下条件的科创板上市的股票和红筹企业发行的存托凭证组成:

1) 上市时间超过6个月;

2) 非退市风险警示证券;

(2) 选择方法

1) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券,剔除科创50指数样本以及过去一年日均总市值排名样本前40名的证券作为待选样本;

2) 对待选样本按照过去一年的日均总市值由高到低排名,选取排名在100名之前的证券作为指数样本。

(3) 指数计算

上证科创板100指数的计算公式为:

报告期指数=报告期样本的调整市值/除数×1000

其中,调整市值 =  $\Sigma$ (证券价格 × 调整股本数 × 权重因子)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于0和1之间,以使单个样本权重不超过10%,前五大样本权重合计不超过40%。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站,网址:<http://www.csindex.com.cn>。

本基金可投资存托凭证,基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响,存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

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“风险揭示”章节的内容。

本基金主要投资于标的指数的成份股和备选股。如指数成份股发生

明显负面事件面临退市或违约风险时,可能在一定时间后被剔除指数成份股,或由于尚未达到指数剔除标准,仍存在于指数成份股中。为充分维护基金份额持有人的利益,针对前述风险证券,基金管理人有权降低配置比例或全部卖出,或进行合理估值调整,从而可能造成与标的之间的跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

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识别。

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等

人员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额

的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等基金管理人无法予以控制

的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。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,基金管理人履行

相应程序后,可以启用侧袋机制,具体详见基金合同和本招募说明书的相

关章节。侧袋机制实施期间,基金管理人将对基金简称进行特殊标识,并不

办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本

基金启用侧袋机制时的特定风险。

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

投资者在T日规定时间内提交的认购申请,应于T+2日后(含该日)通过基金管理人直销系统、基金管理人的客户服务系统或其他销售机构查询认购申请是否被成功受理。

投资者应于基金合同生效后通过基金管理人直销系统、基金管理人的客

户服务中心或其他销售机构查询认购确认份额。

**3、认购的限额**

(1) 在募集期内,投资者可多次认购基金份额。在其他销售机构及基金管理人直销机构(含直销中心与网上直销系统)的首次单笔最低认购金额为人民币0.01元(含认购费,下同),追加认购的单笔最低认购金额为人民币0.01元。各销售机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。但最低认购金额不得低于人民币0.01元。

(2) 募集期间不设置投资者单个账户持有基金份额的比例和最高认购金额限制,但招募说明书另有规定的除外。

(3) 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等人员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(基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员作为发起资金提供方除外)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。

</