

天弘国证航天航空行业交易型开放式指数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:中信证券股份有限公司

重要提示

1. 天弘国证航天航空行业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)于2025年3月17日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可[2025]1522号)。

2. 本基金类别为股票型证券投资基金,运作方式为交易型开放式。

3. 本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”),基金托管人为中信证券股份有限公司,登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4. 本基金募集对象为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、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。

5. 本基金自2025年5月6日至2025年5月16日(周六、周日和节假日不受理)进行发售。投资人可选择网上现金认购和网下现金认购两种方式。

6. 本基金网上现金发售通过具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理。

7. 网下现金认购发售代理机构具体详见“八、本次募集有关当事人或中介机构(三)销售机构”。

8. 投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所人民币普通股票账户(即深圳A股账户)或深圳证券交易所证券投资基金账户(以下统称“深圳证券账户”),已有深证证券账户的投资者不必再办理开户手续。尚未在深圳证券账户的投资人,需在认购前持本人身份证件到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳证券账户的开户手续。关于开设深圳证券账户的具体程序和办法,请到各开户网点详细咨询有关规定。如投资人需新开立深圳证券账户,则应注意:(1)如投资人需要参与网下现金或网上现金认购,应使用深圳证券账户;深圳证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易;(2)如投资人以深圳证券交易所上市的本基金的指数成份股或备选成份股进行网下股票认购或申购的场内申购赎回的,则应立即并使用深圳A股账户;(3)已购买过由天弘基金管理有限公司担任登记机构的基金的投资者,其拥有的天弘基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

9. 本基金认购费用或认购金额不高于0.80%。

10. 本基金首次募集规模上限为50亿元人民币(不含募集期利息),采用末日比例确认的方式实现募集规模的有效控制。若本基金在募集期间任任何一天(含第一天)当日募集截止后时间,基金募集总规模超过募集规模上限,基金管理人将提前结束本次募集并予以公告,未确认部分的认购款项将在募集期结束后退还给投资者,由此产生的利息等损失由投资人自行承担。

11. 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,投资人应及时查询并妥善行使表决权,否则由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

12. 基金募集期间募集的资金应当存入专门账户,在基金合同生效前,任何人不得动用。

13. 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)及中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)的《天弘国证航天航空行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《天弘国证航天航空行业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

14. 本公司在募集期内可能新增或变更销售机构,投资者可留意本公司及各发售代理机构的公告或网站公示,或拨打本公司客服电话(95046)及各发售代理机构的客服电话进行咨询。

15. 基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。

16. 风险提示

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注册,并不表示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,也不表示投资于本基金没有风险。

证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。证券投资基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带的损失。

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、数量等投资行为独立作出决策。投资人获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中的各类风险,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、大量赎回或巨额赎回的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险。同时由于本基金是交易型开放式指数证券投资基金,特定风险还包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、成分股停牌的风险、跟踪误差风险、成分股停牌的风险、成份股停牌的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、成分股停牌的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场价格交易价格溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、退市风险等等。基金管理人提醒投资者基于投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运作状况与基金净值变化引起的投资风险,由投资者自行负责。

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。

本基金按照深圳证券交易所及中国证监会登记结算有限责任公司的相关规定进行申购、赎回,具体业务的办理时间请参见相关公告。本基金通过办理场内申购赎回的,投资者的申购、赎回申请在T日确认,申购所得ETF份额T日可竞价卖出,“+1”日可赎回或者大宗卖出;赎回所得的组合证券当日可竞价卖出,T+1日可用于申购ETF份额或大宗卖出。本基金暂时不开通场外组合证券申购赎回业务,若基金管理人日后开通该申赎模式的,将提前发布公告,且无须召开基金份额持有人大会。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以标的指数的成份股及具备选股成份股为主要投资对象。如指数成份股发生明显负面事件面临退市风险时,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加大。

本基金为股票型基金,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。本基金为指数型基金,采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表股票市场的相似的风险收益特征。

本基金的指数为国证航天航空行业指数。

1. 选择空间

满足下列条件的A股和红筹企业发行的存托凭证:

(1) 非ST、“ST”证券;

(2) 科创板证券,北交所证券上市时间超过1年,其他证券上市时间超过6个月;

(3) 公司最近一年无重大违规、无重大亏损;

(4) 公司最近一年经营无异常、无重大亏损;

(5) 考察期内证券价格无异常波动;

(6) 公司所属国证三级别行业为航天航空。

2. 选择方法

(1) 备选池:

对满足入围标准的证券,计算一段时期(一般为前六个月)证券日均自由流通市值和日均成交金额,分别从高到底排序。若入围证券数量超过10只,则剔除成交金额排名后10%的证券,剩余证券作为备选池;若入围证券数量等于或小于10只,则全部纳入备选池。

(2) 样本数量

样本数量的确定,考察备选池的样本数量和自由流通市值覆盖率两个指标,具体确定方法如下:

备选证券(N)
N<30 样本数量
全仓入选

30≤N<50 1. 确定自由流通市值覆盖率到达80%的证券数量,取大于等于该数值的最小的10的倍数
M;
2. 在M与N之间,选取大值作为样本数量。

N≥50 1. 确定自由流通市值覆盖率到达80%的证券数量,取大于等于该数值的最小的10的倍数
M;
2. 在M与N之间,选取最小值作为样本数量。

(3) 样本筛选

入围证券按照自由流通市值排名,依次入选,直至达到确定的样本数量。

3. 指数计算:

指数采用派氏加权法,依据下列公式逐日连锁实时计算:

其中,样本权数调整方法参见指数计算与维护细则,权重调整因子见“样本权重调整系数”。

4. 样本调整

(1) 样本定期调整

样本定期调整于每年6月和12月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本调整方案通常在实施前两周公布。

样本定期调整遵循数量保持相对稳定的原则,若按上期样本数量入选的样本在下期自由流通市值覆盖率低于80%,则样本数量不作调整;若低于80%,则调高样本数量至自由流通市值覆盖率到达85%,如果一次调整幅度过大,则分步实施。

在确定新入选样本后,在剩余证券中按日均自由流通市值从高到低排序选取样本数量5%的证券作为备选样本。

(2) 样本临时调整

样本出现终止上市时,将其从指数样本中剔除,选择备选样本名单中排序最靠前的样本补足。

样本公司被实施风险警示,发生收购、合并、分拆情形的处理,同国证1000指数。

5. 样本权重调整

在指数计算中,设置权重调整因子,使单只样本在每次定期调整时的权重不超过15%。

前五大样本权重合计不超过60%。如果样本数量不足10只,则不设置权重限制。

权重调整因子每年调整2次,于样本定期调整时实施。在下一个定期调整日之前,权重调整因子一般固定不变。

当出现样本临时调整时,新样本继承被剔除样本在调整前最后一个交易日的权重,据此计算新样本的权重调整因子。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见深圳证券信息有限公司网站,网址:<http://www.cnindex.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。

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。

基金管理人将对投资者进行风险承受能力评估,并根据评估结果向投资者推荐适合其风险承受能力的基金产品。

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经理委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买本基金。

一、本次募集基本情况

(一) 基金名称

天弘国证航天航空行业交易型开放式指数证券投资基金

场内简称:航空航天ETF天弘

基金代码:159241

(二) 基金类型和运作方式

本基金类型为股票型证券投资基金,运作方式为交易型开放式。

(三) 存续期限

不定期。

(四) 基金份额发售面值和认购价格

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。

(五) 募集规模

本基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币。

本基金首次募集规模上限为50亿元人民币(不含募集期利息)。采用末日比例确认的方式实现募集规模的有效控制。若本基金在募集期间任任何一天(含第一天)当日募集截止后时间,基金募集总规模超过募集规模上限,基金管理人将提前结束本次募集并予以公告,未确认部分的认购款项将在募集期结束后退还给投资者,由此产生的利息等损失由投资人自行承担。

11. 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,投资人应及时查询并妥善行使表决权,否则由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

12. 基金募集期间募集的资金应当存入专门账户,在基金合同生效前,任何人不得动用。

13. 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)及中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)的《天弘国证航天航空行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《天弘国证航天航空行业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

14. 本公司在募集期内可能新增或变更销售机构,投资者可留意本公司及各发售代理机构的公告或网站公示,或拨打本公司客服电话(95046)及各发售代理机构的客服电话进行咨询。

15. 基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。

16. 风险提示

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注册,并不表示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,也不表示投资于本基金没有风险。

证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。证券投资基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带的损失。

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、数量等投资行为独立作出决策。投资人获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中的各类风险,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、大量赎回或巨额赎回的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险。同时由于本基金是交易型开放式指数证券投资基金,特定风险还包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、成分股停牌的风险、跟踪误差风险、成分股停牌的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、成分股停牌的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场价格交易价格溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、退市风险等等。基金管理人提醒投资者基于投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运作状况与基金净值变化引起的投资风险,由投资者自行负责。

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。

本基金按照深圳证券交易所及中国证监会登记结算有限责任公司的相关规定进行申购、赎回,具体业务的办理时间请参见相关公告。本基金通过办理场内申购赎回的,投资者的申购、赎回申请在T日确认,申购所得ETF份额T日可竞价卖出,“+1”日可赎回或者大宗卖出;赎回所得的组合证券当日可竞价卖出,T+1日可用于申购ETF份额或大宗卖出。本基金暂时不开通场外组合证券申购赎回业务,若基金管理人日后开通该申赎模式的,将提前发布公告,且无须召开基金份额持有人大会。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以标的指数的成份股及具备选股成份股为主要投资对象。如指数成份股发生明显负面事件面临退市风险时,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加大。

本基金为股票型基金,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。本基金为指数型基金,采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表股票市场的相似的风险收益特征。

本基金的指数为国证航天航空行业指数。

1. 选择空间

满足下列条件的A股和红筹企业发行的存托凭证:

(1) 非ST、“ST”证券;

(2) 科创板证券,北交所证券上市时间超过1年,其他证券上市时间超过6个月;

(3) 公司最近一年无重大违规、无重大亏损;

(4) 公司最近一年经营无异常、无重大亏损;

(5) 考察期内证券价格无异常波动;

(6) 公司所属国证三级别行业为航天航空。

2. 选择方法

(1) 备选池:

对满足入围标准的证券,计算一段时期(一般为前六个月)证券日均自由流通市值和日均成交金额,分别从高到底排序。若入围证券数量超过10只,则剔除成交金额排名后10%的证券,剩余证券作为备选池;若入围证券数量等于或小于10只,则全部纳入备选池。

(2) 样本数量

样本数量的确定,考察备选池的样本数量和自由流通市值覆盖率两个指标,具体确定方法如下:

备选证券(N)