

天弘中证A100交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

重要提示

1. 天弘中证A100交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)于2024年12月17日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可【2024】1863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“本基金管理人”),基金托管人为国泰海通证券股份有限公司,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6月17日至2025年7月4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上海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上海证券交易所人民币普通股票账户(即A股账户)或上海证券交易所证券投资基金账户(以下统称“上海证券证券账户”)。

已有上海证券账户的投资人不必再办理开户手续。

尚无上海证券账户的投资人,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上海分公司的开户代理机构办理上海证券账户的开户手续。有关开设上海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。

(1) 如投资人需新开立上海证券账户,则应注意:

1) 上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易,如投资人需要使用标的指数成份股或备选成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回,则应开立上海证券交易所人民币普通股票账户。

2) 开户当日无法办理指定交易,建议投资人在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

(2) 如投资人已开立上海证券账户,则应注意:

1) 如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司,需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

2) 当日办理指定交易或转指定交易的投资人当日无法进行认购,建议投资人在进行认购前至少1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

(3) 使用专用交易单元的机构投资人则无需办理指定交易。

(4) 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人,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佣金不高于0.80%。

10. 本基金的最低募集份额总额为2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币。

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。

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. 本公司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《天弘中证A100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《天弘中证A100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,投资人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。

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来的损失。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场价格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。投资人应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。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、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、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、成份股退市的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV计算和IOPV计算错误的风险、投资者申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、退市风险等。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成份股为主要投资对象,如指数成份股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扩大。

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的股票市场的相似的风险收益特征。

本基金按照上海证券交易所及中国证券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。投资人申购的基金份额当日起可卖出,投资人赎回获得的证券当日起可卖出。

本基金标的指数为中证A100指数。

1. 样本空间

1.1 同中证指数的样本空间

2. 可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前90%。

3. 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,剔除中证ESG评价结果在C及以下的上市公司证券;

(2) 选取同时满足以下条件的证券作为待选样本:

① 样本空间内总市值排名前300;

② 属于沪深股通或深股通证券范围。

(3) 在待选样本中,优先选取中证二级行业自由流通市值最大且总市值位于样本空间前100名的上市公司证券作为指数样本;

(4) 在剩余待选样本中,从各中证一级行业按照自由流通市值选取一定数量证券,使样本数量达到100只,且各一级行业自由流通市值分布与样本空间尽可能一致。

4. 指数计算

指数计算公式为:

$$\text{指数指数} = \sum (\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子}) \times 1000$$

其中,调整市值 = $\sum (\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$,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,使单个样本权重不超过10%。

5. 指数样本和权重调整

5.1 定期调整

指数样本每半年调整一次,样本调整实施时间为每年6月和12月的第二个星期五的下一交易日。权重因子随样本定期调整而调整,调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前,权重因子一般固定不变,每次调整的样本比例一般不超过20%。定期调整设置缓冲区,选择方法(4)中的入选顺序在前80名的新样本优先入选,在前120名的老样本优先保留。

5.2 临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时,将其从指数样本中剔除。当沪股通或深股通证券范围发生变动导致样本不再满足互联互通资格时,指数将相应调整。

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>。

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:国泰海通证券股份有限公司

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人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人: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。

投资人应当认真阅读《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。

已有上海证券账户的投资人不必再办理开户手续。

尚无上海证券账户的投资人,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上海分公司的开户代理机构办理上海证券账户的开户手续。有关开设上海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。

(1) 如投资人需新开立上海证券账户,则应注意:

1) 上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易,如投资人需要使用标的指数成份股或备选成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回,则应开立上海证券交易所人民币普通股票账户。

2) 开户当日无法办理指定交易,建议投资人在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

(2) 如投资人已开立上海证券账户,则应注意:

1) 如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司,需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

2) 当日办理指定交易或转指定交易的投资人当日无法进行认购,建议投资人在进行认购前至少1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

(3) 使用专用交易单元的机构投资人则无需办理指定交易。

(4) 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人,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佣金不高于0.80%。

10. 本基金的最低募集份额总额为2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币。

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。

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. 本公司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《天弘中证A100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《天弘中证A100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,投资人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。

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来的损失。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场价格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。投资人应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。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、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、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、成份股退市的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV计算和IOPV计算错误的风险、投资者申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、退市风险等。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成份股为主要投资对象,如指数成份股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扩大。

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的股票市场的相似的风险收益特征。

本基金按照上海证券交易所及中国证券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。投资人申购的基金份额当日起可卖出,投资人赎回获得的证券当日起可卖出。

本基金标的指数为中证A100指数。

1. 样本空间

1.1 同中证指数的样本空间

2. 可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前90%。

3. 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,剔除中证ESG评价结果在C及以下的上市公司证券;

(2) 选取同时满足以下条件的证券作为待选样本:

① 样本空间内总市值排名前300;

② 属于沪深股通或深股通证券范围。

(3) 在待选样本中,优先选取中证二级行业自由流通市值最大且总市值位于样本空间前100名的上市公司证券作为指数样本;

(4) 在剩余待选样本中,从各中证一级行业按照自由流通市值选取一定数量证券,使样本数量达到100只,且各一级行业自由流通市值分布与样本空间尽可能一致。

4. 指数计算

指数计算公式为:

$$\text{指数指数} = \sum (\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子}) \times 1000$$

其中,调整市值 = $\sum (\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$,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,使单个样本权重不超过10%。

5. 指数样本和权重调整

5.1 定期调整

指数样本每半年调整一次,样本调整实施时间为每年6月和12月的第二个星期五的下一交易日。权重因子随样本定期调整而调整,调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前,权重因子一般固定不变,每次调整的样本比例一般不超过20%。定期调整设置缓冲区,选择方法(4)中的入选顺序在前80名的新样本优先入选,在前120名的老样本优先保留。

5.2 临时调整