

关于天弘创新之滚雪球六期集合资产管理计划 投资起始运作公告

根据《天弘创新之滚雪球六期集合资产管理计划资产管理合同》，天弘创新之滚雪球六期集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）已于2021年4月30日投资起始运作，即2021年4月30日为本集合计划投资起始运作日。

期初参考价格为本集合计划挂钩标的中证500指数（代码：000905.SH）在期初观察日（同投资起始运作日）的收盘价，具体为【6485.71】；敲出价格=期初参考价格*100%（按照四舍五入精确至小数点后2位），即【6485.71】；敲入价格=期初参考价格*75%（按照四舍五入精确至小数点后2位），即【4864.28】。

本集合计划后续安排如下：

1、本集合计划自投资起始运作日起满2年称为“首个运作期间”，期间封闭运作，首个运作期间内敲出付息观察日以及如发生敲出事件后提前终止日安排如下：

第 i 个月	敲出付息观察日	如发生敲出事件后的提前终止日
i=3	2021年7月29日	2021年7月30日
i=4	2021年8月27日	2021年8月30日
i=5	2021年9月29日	2021年9月30日
i=6	2021年10月29日	2021年11月1日
i=7	2021年11月29日	2021年11月30日
i=8	2021年12月29日	2021年12月30日
i=9	2022年1月28日	2022年2月7日
i=10	2022年2月28日	2022年3月1日
i=11	2022年3月29日	2022年3月30日
i=12	2022年4月29日	2022年5月2日
i=13	2022年5月27日	2022年5月30日
i=14	2022年6月29日	2022年6月30日
i=15	2022年7月29日	2022年8月1日
i=16	2022年8月29日	2022年8月30日
i=17	2022年9月29日	2022年9月30日



i=18	2022年10月28日	2022年10月31日
i=19	2022年11月29日	2022年11月30日
i=20	2022年12月29日	2022年12月30日
i=21	2023年1月20日	2022年1月30日
i=22	2023年2月28日	2023年3月1日
i=23	2023年3月29日	2023年3月30日
i=24 (期末观察日)	2023年4月28日	2023年5月2日

如按照合同推算出的敲出付息观察日或提前终止日为非交易日,则自动顺延至该日后的第一个交易日。

若存在某一敲出付息观察日挂钩标的收盘价大于或等于敲出价格(即发生敲出事件),本集合计划于对应的提前终止日终止。

2、若首个运作期间内所有的敲出付息观察日挂钩标的收盘价均小于敲出价格,且观察期内所有的预定交易日挂钩标的收盘价均大于或等于敲入价格,则本集合计划于期末观察日对应的提前终止日终止。

3、若首个运作期间内所有的敲出付息观察日挂钩标的收盘价均小于敲出价格,且观察期内存在某一预定交易日挂钩标的收盘价小于敲入价格(即发生敲入事件),则本集合计划在投资起始运作日起满24个月的对日(如遇非工作日,则往后顺延至最近一个工作日)开放参与和退出,首次开放日后每满3个月的对日(如遇非工作日,则往后顺延至最近一个工作日)开放参与和退出,具体开放日、开放时间届时以管理人网站公告为准。在此期间,本集合计划将变更投资策略采取指数增强策略进行投资,具体方式为精选挂钩标的指数(中证500指数)的增强型收益凭证或收益互换等金融衍生品,力求在追踪挂钩标的指数表现基础上获得额外的增强回报。

特此公告。



 天弘创新资产管理有限公司
 2021年4月30日