

**关于天风六个月滚动持有债券型集合资产管理计划
新增份额可能触发持有期不满一个运作期情形的提示性公告**

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《天风六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）的有关规定，天风六个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）新增份额可能触发不满一个运作期情形，现将相关事项提示公告如下：

一、本集合计划基本信息

集合计划名称	天风六个月滚动持有债券型集合资产管理计划	
集合计划简称	天风六个月滚动债	
集合计划主代码	970039	
下属份额的简称	天风六个月滚动债 A	天风六个月滚动债 C
下属份额的交易代码	970039	970040
集合计划运作方式	契约型开放式	
集合计划合同生效日	2021 年 9 月 22 日	
集合计划管理人名称	天风（上海）证券资产管理有限公司	
集合计划托管人名称	兴业银行股份有限公司	
集合计划注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司	

二、新增份额可能触发持有期不满一个运作期的情形说明

根据《资产管理合同》“第四部分 集合计划的基本情况”之“三、集合计划的运作方式”及“六、集合计划存续期限”的约定：

“对于每份集合计划份额，第一个运作期指资产管理合同生效日（对本资产管理合同生效前相应份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日满 6 个月对应的月度对日（即第一个运作期到期日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一工作日起，至资产管理合同生效日或集合计

划份额申购申请日满 12 个月对应的月度对日止。第三个运作期指第二个运作期到期日的次一工作日起，至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日满 18 个月对应的月度对日止。以此类推。”

“本集合计划自资产管理合同生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划自资产管理合同生效日起 3 年后，按照中国证监会有关规定执行。”

本集合计划资产管理合同 2021 年 9 月 22 日生效，至 2024 年 9 月 22 日满三年。因此 2024 年 3 月 22 日后新增份额可能触发持有期不满一个运作期情形（即投资者于 2024 年 3 月 22 日后申购的份额持有期至终止日不满足 6 个月）。本集合计划存续期届满，若未能延期，本集合计划的终止而进入到清算期，投资者持有的份额届时按照清算期安排进行（即投资者的份额实际持有期至清算完成日可能超过 6 个月）。特提请投资者注意相关风险。

三、其他需要提示的事项

1、若发生上述集合计划合同终止情形，本集合计划管理人将根据相关法律法规规定和《资产管理合同》约定等成立集合计划财产清算小组，履行集合计划财产清算程序。本集合计划进入清算程序后，投资者将无法办理本集合计划的申购、赎回等业务。敬请投资者注意投资风险，妥善做好投资安排。

2、投资者欲了解本集合计划的详细情况，请认真阅读《资产管理合同》等法律文件及相关公告。

3、投资者可以拨打本公司客户服务电话 95391/400-800-5000、登录管理人网站（<https://www.tfzqam.com>）咨询、获取本集合计划的相关事宜。天风（上海）证券资产管理有限公司对本公告具有最终解释权。

特此公告。

天风（上海）证券资产管理有限公司

2024 年 3 月 21 日