

天弘国证消费100指数增强型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要(更新)

编制日期: 2024年06月27日

送出日期: 2024年06月28日

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。

作出投资决定前,请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	天弘国证消费100指数增强	基金代码	010771
基金简称A	天弘国证消费100指数增强A	基金代码A	010771
基金管理人	天弘基金管理有限公司	基金托管人	广发证券股份有限公司
基金合同生效日	2020年12月30日		
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	刘笑明	开始担任本基金基金经理的日期	2021年01月06日
		证券从业日期	2014年07月15日
其他	本基金在《基金合同》生效三年后继续存续的,基金存续期内,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续50个工作日出现前述情形的,本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止,且无需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

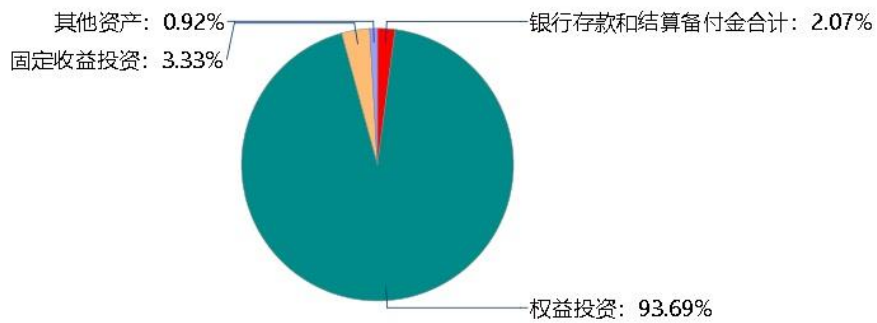
投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,力争获取高于标的指数的投资收益。
投资范围	本基金的标的指数为国证消费100指数。 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资

	范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
主要投资策略	本基金主要投资策略有：资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、其他类型资产投资策略。
业绩比较基准	国证消费100指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	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。

注：详见《天弘国证消费100指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》"基金的投资"章节。

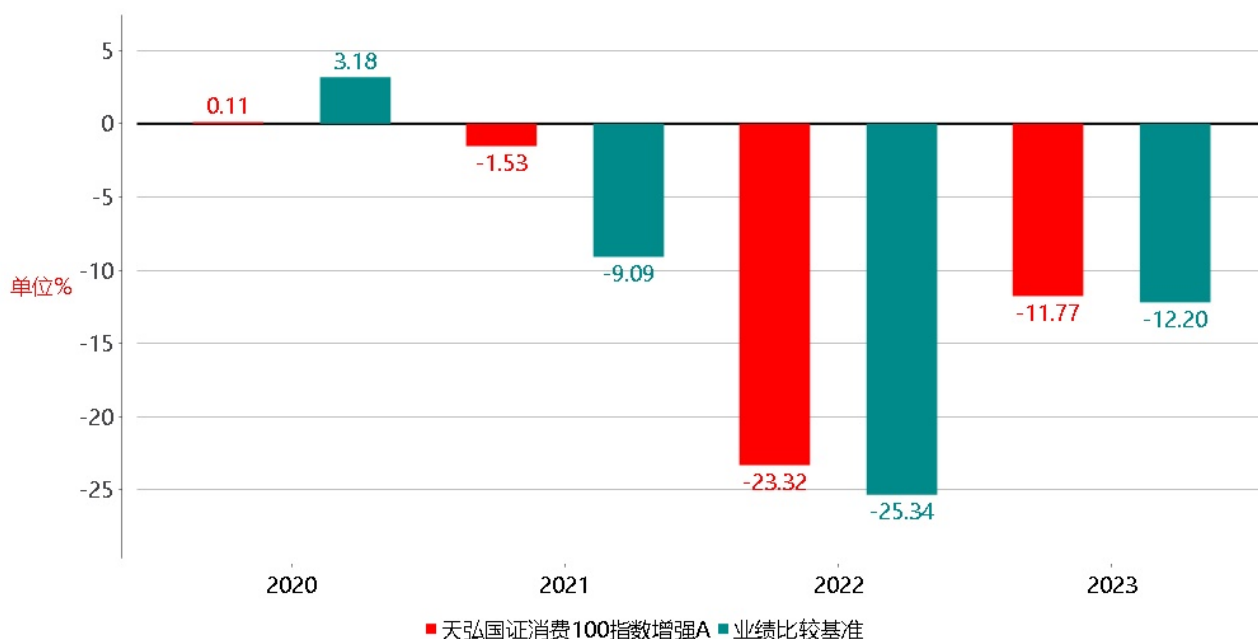
(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日期：2024年03月31日



(三) 自基金合同生效以来 / 最近十年 (孰短) 基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日期：2023年12月31日
基金合同生效当年期间的相关数据按实际存续期计算



三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
申购费	M<100万	1.50%	
	100万≤M<200万	1.00%	
	200万≤M<500万	0.60%	
	500万≤M	1000元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	0.75%	
	30天≤N<180天	0.50%	
	180天≤N	0.00%	

注：同一交易日投资人可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.60%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	60,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊
指数许可使用费	0.02%；年下限金额：32,000.00 元	指数编制公司
其他费用	合同约定的其他费用，包括律师费、	第三方收取方

	诉讼费等。	
--	-------	--

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。
2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

基金运作综合费率（年化）
0.87%

注：基金管理费率、托管费率为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、本基金特有风险：

（1）本基金为股票指数增强型证券投资基金，股票资产占基金资产的比例不低于90%，其中投资于标的指数成份股或备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，在股票市场发生较大波动时，本基金系统性风险较大，可能对基金的净值产生较大影响。

（2）本基金采用指数增强量化投资策略进行选股用于增强收益的目的，但不基于量化策略进行频繁交易。在基金投资过程中，多个环节会使用量化选股模型，存在量化模型失效导致基金业绩收益不佳的风险。

（3）本基金采用量化增强策略，使用基金管理人的量化投资团队开发的多因子 α 预测模型、结构化风险模型和交易成本估计模型，通过组合优化的方法构建出股票增强组合，其主要工作流程包括采集数据、调用模型分析数据、计算目标持仓等几个部分，蕴含了数据风险和模型风险；本基金建立量化模型的数据来源包括宏观数据、行业信息、上市公司基本财务数据、证券及期货市场交易行情数据、卖方分析师预期及评级数据等多种数据，广泛涵盖各类信息源，相关数据来源于不同数据提供商，且按不同的需求和规范进行预处理。在数据采集、预处理等过程中可能发生数据错误风险，从而对量化模型输出结果造成影响。本基金基于量化模型进行投资决策，量化投资方法的缺陷在一定程度上会影响本基金的表现。一方面，面对不断变换的市场环境，量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中；另一方面，在量化模型的实际运用中，核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性；最后，定量模型存在对历史数据的依赖。因此，在实际运用过程中，市场环境的变化可能导致遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

（4）跟踪误差控制未达约定目标的风险。本基金力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

（5）成份股停牌的风险。标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

- 1）基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；
- 2）在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以

获取足额的符合要求的赎回款项，由此基金管理人可能设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

(6) 成份股退市的风险。标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

(7) 指数编制机构停止服务的风险。本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险；自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

(8) 《基金合同》自动终止的风险。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，本基金合同应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限；《基金合同》生效三年后继续存续的，连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会。故投资者还将面临《基金合同》自动终止的风险。

(9) 若基金管理人将来注册并成立追踪同一标的指数的增强交易型开放式指数基金(ETF)，在不改变本基金投资目标的前提下，本基金可变更为该ETF的联接基金。投资者还有可能面临基金自动转型的风险。

2、其他风险：本基金产品存在市场风险、信用风险、流动性风险、启用侧袋机制的风险、投资股指期货的风险、资产支持证券投资风险、参与融资与转融通业务的风险、存托凭证投资风险、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、操作风险、管理风险、合规性风险及其他风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册/核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见天弘基金管理有限公司官方网站 [www.thfund.com.cn] [客服电话：95046]

● 《天弘国证消费100指数增强型发起式证券投资基金基金合同》

《天弘国证消费100指数增强型发起式证券投资基金托管协议》

《天弘国证消费100指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》

- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料