

天弘深证基准做市信用债交易型开放式指数
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：兴业银行股份有限公司

目录

重要提示	2
一、本次募集基本情况	7
二、认购方式与相关规定	8
三、投资者开户	15
四、网上现金认购	16
五、网下现金认购	16
六、网下债券认购	18
七、清算与交割	19
八、基金资产的验资与基金合同生效.....	19
九、本次募集有关当事人或中介机构.....	20
十、网下债券认购清单	25

重要提示

1. 天弘深证基准做市信用债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 31 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2024】1971 号）。

2. 本基金类别为债券型证券投资基金，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”），基金托管人为兴业银行股份有限公司，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 1 月 7 日至 2025 年 1 月 20 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、网下现金认购和网下债券认购三种方式。

6. 本基金管理人可办理网下现金发售和网下债券发售。

7. 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。

8. 网下现金认购和网下债券认购发售代理机构具体详见“九、本次募集有关当事人或中介机构（三）销售机构”。

9. 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”）。已有深圳证券账户的投资人不必再办理开户手续。尚无深圳证券账户的投资人，需在认购前持本人身份证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。有关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认购或网上现金认购，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）如投资人以本基金标的指数成份券或备选成份券进行网下债券认购或基金的申购赎回的，则应开立并使用深圳A股账户。（3）已购买过基金管理人其他开放式基

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。

10. 本基金认购费用或认购佣金不高于 0.30%。

11. 本基金首次募集规模上限为 30 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。若本基金在募集期内任何一天（含第一天）当日募集截止时间后，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。

12. 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。

13. 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。网下债券认购所募集的债券由登记结算机构予以冻结。

14. 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《天弘深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《天弘深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

15. 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。

16. 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。

17. 风险提示

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、期货市场，基金净值会因为证券、期货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、数量等投资行为作出独立决策。投资人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：标的指数回报与债券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、成份券停牌的风险、成份券违约的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、基金份额赎回对价的变现风险等等。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，以标的指数的成份券及其备选成份券为主要投资对象。当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，可能在一定时间后被剔除指数成份券，或由于尚未达到指数剔除标准，仍存在于指数成份券中。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。

本基金按照深圳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。投资者的申购、赎回申请在 T 日确认，申购所得 ETF 份额 T 日可赎回或竞价卖出，T+1 日可大宗卖出；赎回所得的组合证券当日可用于申购 ETF 份额、竞价卖出或者申报作为质押券，T+1 日可大宗卖出。

本基金为债券型基金，其预期风险收益水平相应会高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。本基金属于指数基金，采用分层抽样复制策略，跟踪深证基准做市信用债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。

本基金标的指数为深证基准做市信用债指数。

1、名称

指数名称：深证基准做市信用债指数

指数简称：深做市信用债

英文名称：SZSE Market-Making Credit Bond Index

英文简称：SZSEMMCB

2、基日与基点

指数基日为 2022 年 6 月 30 日，基点为 100 点。

3、选样空间

指数以在深圳证券交易所上市流通的利率债、信用债为备选范围。债券币种为人民币。

4、选样方法

以深圳证券交易所基准做市债券清单范围内的公司债、企业债作为指数样本。

5、指数计算

以样本债券的发行量为权数加权，依据下列公式逐日连锁计算：

$$\text{Index}_t = \text{Index}_{t-1} \times \frac{\sum_i (P_{i,t} + AI_{i,t}) * Q_{i,t-1} + \sum_i CPN_{i,t}}{\sum_i (P_{i,t-1} + AI_{i,t-1}) * Q_{i,t-1}}$$

其中：

$P_{i,t}$ ：第 i 只债券第 t 日净价。

$AI_{i,t}$ ：第 i 只债券第 t 日应计利息。

$Q_{i,t}$ ：第 i 只债券第 t 日发行量。

$CPN_{i,t}$ ：第 i 只债券第 t 日息票现金流。

6、样本调整

(1) 样本定期调整方法

每月对样本债券进行检视，时间为月末最后一个交易日，剔除不符合条件的债券，选入符合条件的新样本。样本债券定期调整于检视日的下一交易日实施。

(2) 样本临时调整方法

若样本发生停止交易，自停止交易日起剔除出指数；样本券发生其他事件，参照计算与维护细则处理。

7、权重调整

凡有指数样本发生发行量变动，自下月第一个交易日起修正。

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

为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品，信用衍生品投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌或违约等潜在风险，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节的内容。

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。

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。

一、本次募集基本情况

（一）基金名称

基金名称：天弘深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金

场内简称：信用债ETF天弘

基金代码：159398

（二）基金类型和运作方式

本基金类型为债券型证券投资基金，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（含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的市值）不少于2亿元人民币。

本基金首次募集规模上限为30亿元人民币（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。若本基金在募集期内任何一天（含第一天）当日募集截止时间后，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。

（六）募集对象

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。

（七）基金份额销售机构

本基金的销售机构名单详见本基金发售公告“九、本次募集有关当事人或中介机构（三）销售机构”部分的相关内容。

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。

（八）基金募集时间安排与基金合同生效

1、根据有关法律、法规的规定，本基金的募集期为自基金份额发售之日起不超过三个月。

2、本基金的募集期自2025年1月7日至2025年1月20日（周六、周日和节假日不受理）。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、缩短或调整基金发售时间，并及时公告。

3、本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额（含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的市值）不少于 2 亿元人民币且基金有效认购人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在募集结束之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。网下债券认购所募集的债券由登记结算机构予以冻结。

4、如果募集期限届满，未满足基金备案条件，则基金募集失败。如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息（税后）；对于基金募集期间网下债券认购所募集的债券，登记结算机构应予以解冻，基金管理人不承担相关债券冻结期间交易价格波动的责任。登记结算机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和债券的退还工作。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

二、认购方式与相关规定

1、认购方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购三种方式认购。

2、认购费率

募集期投资人可以多次认购本基金，按每笔认购份额确定认购费率，以每笔认购申请单独计算费用。基金投资人认购本基金基金份额时收取认购费用。本基金对通过基金管理人认购基金份额的养老金客户实施优惠的认购费率。

养老金客户包括基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：

- (1) 全国社会保障基金；
- (2) 可以投资基金的地方社会保障基金；
- (3) 企业年金单一计划以及集合计划；
- (4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；
- (5) 企业年金养老金产品；
- (6) 职业年金计划；
- (7) 养老目标基金；
- (8) 个人税收递延型商业养老保险等产品。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人办理网下现金认购、网下债券认购的养老金客户的优惠认购费率见下表：

认购份额 (M)	认购费率
M<50万份	0.030%
50万份≤M<100万份	0.015%
M≥100万份	每笔500元

通过基金管理人办理网下现金认购、网下债券认购的非养老金客户的认购费率见下表：

认购份额 (M)	认购费率
M<50万份	0.30%
50万份≤M<100万份	0.15%
M≥100万份	每笔500元

发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购时可参照上述费率结构，按照不高于0.30%的标准收取一定的佣金，具体标准见代销机构的规则。通过基金管理人或发售代理机构进行网下债券认购的投资者，在基金管理人或发售代理机构允许的条件下，可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用

(或佣金)。

3. 认购份额的计算

网上现金认购

1、认购原则与认购限额

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。**网上现金认购可多次申报，申报提交后不得撤销，申报一经确认，认购资金即被冻结。**

2、认购金额的计算

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额和利息折算的份额的计算公式为：

$$\text{认购佣金} = \text{认购份额} \times \text{认购价格} \times \text{佣金比率}$$

(若适用固定费用的，认购佣金=固定费用)

$$\text{认购金额} = \text{认购份额} \times \text{认购价格} \times (1 + \text{佣金比率})$$

(若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

$$\text{利息折算的份额} = \text{利息} / \text{认购价格}$$

$$\text{认购总份额} = \text{认购份额} + \text{利息折算的份额}$$

认购佣金由发售代理机构向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

有效的网上现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

例：某投资人通过某发售代理机构采用现金方式认购1,000份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.30%，并假设认购资金募集期间产生的利息为2元，则需准备的资金金额计算如下：

$$\text{认购佣金} = 1,000 \times 1.00 \times 0.30\% = 3 \text{元}$$

$$\text{认购金额} = 1,000 \times 1.00 \times (1 + 0.30\%) = 1,003 \text{元}$$

利息折算的份额=2/1.00=2份

认购总份额=1,000+2=1,002份

即：某投资人通过某发售代理机构采用网上现金方式认购 1,000 份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.30%，该投资人需准备 1,003 元资金，方可认购到 1,000 份本基金基金份额，加上募集期间利息折算的基金份额后一共可以得到 1,002 份基金份额。

3、认购确认

在基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

4、清算交收

投资者提交的认购申请，由登记结算机构进行有效认购款项的清算交收。

网下现金认购

1、认购原则与认购限额

投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后如需撤销以销售机构的规定为准。

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在5万份以上（含5万份）。投资人可多次认购，累计认购份额不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

2、通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额的计算：

通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额和利息折算的份额的计算公式为：

认购费用=认购份额×认购价格×认购费率

（若适用固定费用的，认购费用=固定费用）

认购金额=认购份额×认购价格×（1+认购费率）

（若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

利息折算的份额=利息/认购价格

认购总份额=认购份额+利息折算的份额

认购费用由基金管理人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。有效的网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。有效认购款项的利息和具体折算的份额以基金管理人的记录为准。利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

例：某投资人（非养老金客户）通过基金管理人认购本基金500,000份，认购费率为0.15%，假定认购金额产生的利息为100元，则该投资人的认购金额为：

认购费用=500,000×1.00×0.15%=750元

认购金额=500,000×1.00×(1+0.15%)=500,750元

利息折算的份额=100/1.00=100份

该投资人所得认购总份额为：

认购总份额=500,000+100=500,100份

即：某投资人（非养老金客户）通过基金管理人认购本基金500,000份，认购费率为0.15%，假定认购金额产生的利息为100元，则该投资人的认购金额为500,750元，可得到500,100份基金份额。

例：某养老金客户通过基金管理人认购本基金500,000份，认购费率为0.015%，假定认购金额产生的利息为100元，则该投资人的认购金额为：

认购费用=500,000×1.00×0.015%=75元

认购金额=500,000×1.00×(1+0.015%)=500,075元

利息折算的份额=100/1.00=100份

该投资人所得认购总份额为：

认购总份额=500,000+100=500,100份

即：某养老金客户通过基金管理人认购本基金500,000份，认购费率为0.015%，假定认购金额产生的利息为100元，则该投资人的认购金额为500,075元，可得到500,100份基金份额。

3、通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

4、认购确认

基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

5、清算交收

通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由登记结算机构进行有效认购款项的清算交收。

网下债券认购

1、认购原则与认购限额

投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购债券。网下债券认购申请提交后如需撤销以销售机构的规定为准。

网下债券认购以单只债券张数申报，用于认购的债券原则上是深证基准做市信用债指数的成份券和已经公告的备选成份券，基金管理人有权在募集期内根据实际情况调整可以用于认购的债券范围。单只债券最低认购申报张数为100张，超过100张的部分须为10张的整数倍。投资人可多次提交认购申请，累计申报数不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

2、特殊情形包括但不限于以下几种情况：

(1) 已经公告的即将被调出深证基准做市信用债指数的成份券不得用于认购本基金。

(2) 限制个券认购规模：基金管理人可根据网下债券认购日前3个月的个券的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个券认购规模进行限制，并在网下债券认购日前公告限制认购规模的个券名单。

(3) 临时拒绝个券认购：对于在网下债券认购期间价格波动异常，或者认购申报数量异常、长期停牌、流通受限或存在其它异常情况的个券，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该债券的认购申报。

(4) 根据法律法规本基金不得持有的标的指数成份券，将不能用于认购本基金。

3、认购份额的计算公式

投资者的认购份额 = $\frac{\sum_{i=1}^n \text{第 } i \text{ 只债券的价值} \times \text{有效认购数量}}{1.00}$

其中：

(1) i代表投资者提交认购申请的第i只债券，n代表投资者提交的债券总只数。如投资者仅提交了1只债券的申请，则n=1。

(2) T日为网下债券认购期的最后一日。

(3) D日为债券过户日。

(4) “第i只债券的价值”指第i只债券在T日的第三方估值基准服务机构估值价（注：如无特别所指，则为估值净价，下同）+截至（D-1）日应计利息。

若某一债券在T日至D日的冻结期间发生利息兑付等权益变动情况，则由于投资人获得了相应的权益，基金管理人将相应调整应计利息的计算。

(5) “有效认购数量”是指由基金管理人确认的并由登记结算机构完成清算交收的债券数量。其中，

①若基金管理人在网下债券认购日前公告了限制认购规模的个券名单，则对于经公告限制认购规模的个券，基金管理人可确认的认购数量上限的确认方法在届时公告中列示。

②若某一债券在网下债券认购日至D日的冻结期间发生司法执行，则基金管理人将根据登记结算机构发送的解冻数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

③通过基金管理人或发售代理机构进行网下债券认购的投资者，在基金管理人或发售代理机构允许的条件下，投资者可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用（或佣金）。

投资者选择以现金方式支付认购费用（或佣金），则需支付的认购费用（或佣金）按以下公式计算：

认购费用（或佣金）=认购价格×认购份额×认购费率（或佣金比率）

投资者选择以基金份额方式支付认购费用（或佣金）的，根据基金管理人或发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的认购费用（或佣金），并从投资者的认购份额中扣除，为基金管理人或发售代理机构增加相应的基金份额。

以基金份额支付认购费用（或佣金），则认购费用（或佣金）和可得到的基金份额按以下公式计算：

认购费用（或佣金）=认购价格×认购份额/（1+认购费率（或佣金比率））
×认购费率（或佣金比率）

净认购份额=认购份额-认购费用（或佣金）/基金份额发售面值

4、清算交收

T日日终（T日为本基金发售期最后一日），发售代理机构将债券认购数据按投资人证券账户汇总发送给基金管理人。本基金募集期最后一日日终，基金管理人初步确认各成份券的有效认购数量。登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据，将投资人申请认购的债券过户至本基金证券认购专户，完成验资后划入基金证券账户。基金管理人为投资人计算认购份额，并根据发售代理机构提供的数据计算投资人应以基金份额方式支付的佣金，并从投资人的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。基金合同生效后，登记结算机构根据基金管理人提供的投资人净认购份额明细数据进行投资人认购份额的初始登记。

5、认购确认

基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

三、投资者开户

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”）。

已有深圳证券账户的投资人不必再办理开户手续。

尚无深圳证券账户的投资人，需在认购前持本人身份证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。有关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认购或网上现金认购，应使用深圳证券账户；深圳证券交易所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）如投资人以本基金标的指数成份券或备选成份券进行网下债券认购或基金的申购赎回的，则应开立并使用深圳 A 股账户。

（3）已购买过基金管理人其他开放式基金的投资人，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。

四、网上现金认购

1. 认购时间：2025年1月7日至2025年1月20日（周六、周日和节假日不受理），上午9：30—11：30和下午13：00—15：00。

2. 认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

3. 认购手续：投资人直接通过发售代理机构办理认购。

（1）开立深圳A股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户。

（2）在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

（3）投资者可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托。网上现金认购申请提交后，不可撤单，申请一经确认，认购资金即被冻结。

具体时间和认购手续以深圳证券交易所和发售代理机构的相关规则为准。

五、网下现金认购

（一）直销机构

1. 认购时间：2025年1月7日至2025年1月20日（周六、周日和节假日不受理），9：30至17：00。

2. 认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在5万份以上（含5万份）。投资人可多次认购，累计认购份额不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

3. 认购手续

投资人到基金管理人直销网点提供下列资料办理基金的认购手续：

（1）个人投资者提供身份证件原件及复印件（如为第二代身份证需正反面复印件）；

（2）机构投资者提供企业营业执照正本或副本原件及加盖单位公章的复印

件；事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件；法定代表人授权委托书；法人和业务经办人有效身份证件原件及复印件（身份证、军人证或护照）；

（3）深圳证券交易所A股账户卡或证券投资基金账户卡（原件和复印件）；

（4）《专业投资者风险告知及确认函》或者《普通投资者风险告知及确认函》，若为专业投资者还需提供相关证明文件；

（5）个人投资者签署《开放式基金客户风险承受能力测试问卷》（个人版），机构投资者签署《开放式基金客户风险承受能力测试问卷》（机构版）；

（6）加盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件；

（7）填妥的《ETF基金网下认购业务申请表》；

（8）基金管理人要求提供的其他有关材料。

4. 投资者办理本基金的认购需将足额认购资金汇入本公司以下基金直销资金账户：

账户名称：天弘基金管理有限公司

开户银行：中国工商银行天津市西康路支行

银行账号：0302011229300234825

人民银行大额支付系统联行号：102110000156

投资人所填写的票据在汇款用途中必须注明购买的基金名称和基金代码，并确保认购期间每日17:00前到账。

5. 注意事项：

（1）投资人在认购时不能使用天弘基金管理有限公司开放式基金账户，而需使用深圳A股账户卡或深圳证券交易所证券投资基金账户卡。

（2）若个人投资者的认购资金在认购申请当日17:00之前未到达本公司指定的直销资金账户，则当日提交的申请顺延受理，申请受理日期（即有效申请日）以资金到账日为准。在本基金发行截止日的17:00之前，若投资者的认购资金未到达本公司指定账户，则投资者提交的认购申请将可被认定为无效认购。如由于网银系统原因导致到账时间晚于当日17:00的，可顺延至当日下午企业网银关闭的最后时间。

（3）投资人若未按上述规定划付款项，造成认购无效的，本公司及直销资

金账户的开户银行不承担任何责任。

(二) 发售代理机构

1. 认购时间：2025年1月7日至2025年1月20日（周六、周日和节假日不受理），具体业务办理时间由发售代理机构确定。

2. 认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍；投资人可多次认购，累计认购份额不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

3. 认购手续：投资者直接通过发售代理机构办理认购。

(1) 开立深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户。

(2) 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

(3) 投资者填写认购委托单，同时填写委托该发售代理机构代为办理网上现金认购的委托申请书。网下现金认购申请提交后如需撤销以销售机构的规定为准。

具体时间和认购手续以基金管理人或各发售代理机构的规定为准。

六、网下债券认购

1. 认购时间：自2025年1月7日至2025年1月20日（周六、周日和节假日不受理），直销机构网下债券认购的具体业务办理时间为上述日期的9:30—17:00；发售代理机构网下债券认购的具体办理时间由发售代理机构确定。

2. 认购限额：

网下债券认购以单只债券张数申报，用于认购的债券原则上是深证基准做市信用债指数的成份券和已经公告的备选成份券，基金管理人有权在募集期内根据实际情况调整可以用于认购的债券范围。单只债券最低认购申报张数为100张，超过100张的部分须为10张的整数倍。投资人可多次提交认购申请，累计申报数不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

3. 认购手续：

(1) 如投资人以深圳证券交易所上市交易的本基金公告的深证基准做市信

用债指数的成份券和备选成份券进行网下债券认购或基金的场内申购赎回的，则应开立并使用深圳A股账户。

(2)在A股账户中准备足够的符合要求的基金管理人公告的深证基准做市信用债指数的成份券和备选成份券。网下债券认购申请提交后如需撤销以销售机构的规定为准。

其中发售代理机构的具体认购程序以其规定为准。

七、清算与交割

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。网下现金认购及网上现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息将折算为基金份额归投资人所有，利息折算的份额以基金管理人及登记结算机构的记录为准。投资人以债券认购的，认购债券由登记结算机构予以冻结，冻结期间产生的孳息归投资人所有。

八、基金资产的验资与基金合同生效

1. 本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额（含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的市值）不少于 2 亿元人民币且基金有效认购人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在募集结束之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。网下债券认购所募集的债券由登记结算机构予以冻结。

2. 如果募集期限届满，未满足基金备案条件，则基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息（税后）；对于

基金募集期间网下债券认购所募集的债券，登记结算机构应予以解冻，基金管理人不承担相关债券冻结期间交易价格波动的责任。登记结算机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和债券的退还工作。基金管理人、基金托管人和发售代理机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

九、本次募集有关当事人或中介机构

（一）基金管理人

名称：天弘基金管理有限公司

注册地址：天津自贸试验区（中心商务区）新华路 3678 号宝风大厦 23 层

办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

法定代表人：黄辰立

成立时间：2004 年 11 月 8 日

客服电话：95046

（二）基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号

邮政编码：200120

法定代表人：吕家进

成立日期：1988年8月22日

（三）销售机构

1、网下现金发售直销机构

天弘基金管理有限公司直销中心

住所：天津自贸试验区（中心商务区）新华路 3678 号宝风大厦 23 层

办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

法定代表人：黄辰立

电话：（022）83865560

传真：（022）83865564

联系人：司媛

客服电话：95046

2、网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位办理，具体名单如下：

爱建证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东方证券、东莞证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、高华证券、光大证券、广发证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国融证券、国盛证券、国泰君安、国投证券、国新证券、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、华源证券、江海证券、金元证券、开源证券、联储证券、民生证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源、申万宏源西部、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、万联证券、麦高证券、五矿证券、西部证券、西南证券、湘财证券、诚通证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、甬兴证券、粤开证券、长城国瑞、长城证券、长江证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金财富、中金公司、中山证券、中泰证券、中天证券、中信建投、中信山东、中信证券、中信证券华南、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

如果会员单位有所增加或减少，请以深圳证券交易所的具体规定为准，本基金管理人将不就此事项进行公告。

3、网下现金发售代理机构

（1）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：张伟

电话：18610734266

联系人：郭力铭

客户服务热线：400-888-8168、95597

网址：www.htsc.com.cn

(2) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融中心 1 号楼第 20 层
(266061)

法定代表人：肖海峰

电话：0532-85022326

联系人：焦刚

客户服务热线：95548

网址：sd.citics.com

(3) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 20 层

法定代表人：张佑君

电话：010-60834768

联系人：杜杰

客户服务热线：95548

网址：www.cs.ecitic.com

(4) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：陈可可

联系人：陈靖

联系电话：020-88836999

客户服务电话：95548

网址：www.gzs.com.cn

4、网下债券发售代理机构

(1) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：张伟

电话：18610734266

联系人：郭力铭

客户服务热线：400-888-8168、95597

网址：www.htsc.com.cn

(2) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层
(266061)

法定代表人：肖海峰

电话：0532-85022326

联系人：焦刚

客户服务热线：95548

网址：sd.citics.com

(3) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 20 层

法定代表人：张佑君

电话：010-60834768

联系人：杜杰

客户服务热线：95548

网址：www.cs.ecitic.com

(4) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：陈可可

联系人：陈靖

联系电话：020-88836999

客户服务电话：95548

网址：www.gzs.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构调整为本基金的销售机构。

（四）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

电话：010-59378856

传真：010-59378907

联系人：崔巍

（五）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

（六）审计基金资产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

经办注册会计师：蒋燕华、费泽旭

联系人：蒋燕华

十、网下债券认购清单

本基金募集期间，网下债券认购名单如下表所示，但是募集期结束前已经公告的即将被调出深证基准做市信用债指数的成份券不得用于认购本基金。基金管理人可根据网下债券认购日前 3 个月的个券的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个券认购规模进行限制，并在网下债券认购日前公告限制认购规模的个券名单。对于在网下债券认购期间价格波动异常，或者认购申报数量异常、长期停牌、流通受限或存在其它异常情况的个券，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该债券的认购申报。根据法律法规本基金不得持有的标的指数成份券，将不能用于认购本基金。基金管理人有权在募集期内根据实际情况调整可以用于认购的债券范围，具体以基金管理人发布的公告为准。

债券代码	债券简称	债券代码	债券简称
148693.SZ	24 深港 02	149865.SZ	22 广晟 03
148073.SZ	22 南网 01	149843.SZ	22 广晟 01
149623.SZ	21 中旅 02	149461.SZ	21 粤高 01
149763.SZ	21 嘉投 03	524025.SZ	24 深投 12
149435.SZ	21 嘉投 02	148844.SZ	24 深投 04
148018.SZ	22 招路 01	148899.SZ	24 深投 06
148490.SZ	23 长轨 G3	148954.SZ	24 深投 10
148422.SZ	23 徐工 01	148939.SZ	24 深投 08
111100.SZ	20 川交 01	148470.SZ	23 深投 06
149896.SZ	22 深资 01	149845.SZ	22 深投 01
524054.SZ	24 深环水 02	149576.SZ	21 深投 03
524022.SZ	24 深环 01	148350.SZ	23 深投 02
149953.SZ	22 创投 02	149474.SZ	21 深投 02
148621.SZ	24 深创投 02	148012.SZ	22 深投 05
148687.SZ	24 深能 01	148702.SZ	24 深铁 08
148931.SZ	24 深业 03	148664.SZ	24 深铁 07
148644.SZ	24 深业 01	148641.SZ	24 深铁 06
148264.SZ	23 深业 01	148733.SZ	24 深铁 09
149813.SZ	22 陕投 01	148611.SZ	24 深铁 02
148258.SZ	23 陕投 01	148624.SZ	24 深铁 04
149765.SZ	22 焦能 01	148476.SZ	23 深铁 15
148617.SZ	24 圆融 01	148452.SZ	23 深铁 12
149881.SZ	22 厦港 01	148413.SZ	23 深铁 10
149737.SZ	21 青城 11	148343.SZ	23 深铁 05
149647.SZ	21 青城 09	148374.SZ	23 深铁 06

149533.SZ	21 嘉城 01	148314.SZ	23 深铁 03
524002.SZ	24 华能资 01	148256.SZ	23 深铁 02
148021.SZ	22 湘路 06	148075.SZ	22 深铁 07
524004.SZ	24 湘路 D1	111090.SZ	20SZMC01
149516.SZ	21 建能 01	149624.SZ	21 深 G11
148792.SZ	24 拱国控 01	149249.SZ	20 深铁 G4
148158.SZ	22 广电 02	148372.SZ	23 国际 P1
148015.SZ	22 广电 01	148465.SZ	23 国际 P7
148646.SZ	24 穗城 04	148398.SZ	23 国际 P3
148615.SZ	24 穗城 03	524019.SZ	24 深担 02
148543.SZ	23 穗城 01	148829.SZ	24 深担 01
149816.SZ	22 广金 01	148092.SZ	22 深担 02
149697.SZ	21 穗交 04	111116.SZ	24 穗铁 02
149293.SZ	20 穗交 01	148074.SZ	22 广铁 G2
148855.SZ	24 粤财 01	149780.SZ	22 广铁 01
148114.SZ	22 粤桥 01	149489.SZ	21 广铁 03
149457.SZ	21 粤桥 01	149424.SZ	21 广铁 02
149912.SZ	22 广新 02	149455.SZ	21 广铁 01

天弘基金管理有限公司

二〇二五年一月三日