

天弘中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2025年09月08日

送出日期：2025年09月09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	天弘中证AAA科技创新公司债ETF	基金代码	159111
基金管理人	天弘基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	暂无	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 暂无
基金类型	债券型	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	尹粒宇	开始担任本基金基金经理的日期	暂无
		证券从业日期	2012年10月08日
其他	1、《基金合同》生效后，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60个工作日出现前述情形的，基金管理人应在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在六个月内召集基金份额持有人大会。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。 2、场内简称：科创债ETF天弘。		

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数。 本基金主要投资于标的指数成份券、备选成份券。为更好地实现投资目标，基金还可投资于包括非成份债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、国债期货、信用衍生品、银行存款、同业存单、货币市场工具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的相关规定）。

	本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 在建仓完成后，本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的80%；本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。 如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	本基金为指数基金，主要采用分层抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构建与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.20%，将年化跟踪误差控制在2%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。本基金的投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券的投资策略、衍生产品投资策略。
业绩比较基准	中证AAA科技创新公司债指数收益率
风险收益特征	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，跟踪中证AAA科技创新公司债指数，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。

注：详见《天弘中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数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

注：天弘中证AAA科技创新公司债ETF无历史数据。

（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

注：天弘中证AAA科技创新公司债ETF无历史数据。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
认购费	M<50万	0.30%	非特定投资主体
	50万≤M<100万	0.15%	非特定投资主体
	100万≤M	500元/笔	非特定投资主体
	M<50万	0.03%	特定投资主体
	50万≤M<100万	0.015%	特定投资主体

	100万≤M	500元/笔	特定投资主体
申购费	投资人在申购本基金时，申购赎回代理券商可按照不超过0.50%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。		
赎回费	投资人在赎回本基金时，申购赎回代理券商可按照不超过0.50%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。		

注：1、基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金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；

2、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。认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；

3、场内交易费用以证券公司实际收取为准。

（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	0.15%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
其他费用	合同约定的其他费用，包括律师费、诉讼费等。	第三方收取方

注：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。

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。

本基金特有风险：1、标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险：标的指数并不能完全代表整个债券市场。标的指数成份券的平均回报率与整个债券市场的平均回报率可能存在偏离。2、标的指数波动的风险：标的指数成份券的价格可能受到政治因素、经济因素、发行人经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险：以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：（1）由于标的指数调整成份券或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。（2）成份券在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。（3）由于标的指数是每天将利息进行再投资的，而组合债券利息收入只在卖券时和债券付息时才收到利息部分的现金，然后才可能进行这部分资金的再投资，因此在利息再投资方面可能会导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。另外，指数成份券在付息时，根据法规，持有人需缴纳利息税，因此实际收到的利息金额将低于票面利息金额，相应的，利息再投资收益也较全额票面利息降低，该两方面差异也进一步导致基金收益率偏离标的指数收益率和加大跟踪误差偏离度。（4）由于成份券停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。（5）由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪

误差。(6)在本基金指数化投资过程中,基金管理人的管理能力,例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等,都会对本基金的收益产生影响,从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。(7)其他因素产生的偏离。基金投资组合中个别债券的持有比例与标的指数中该债券的权重可能不完全相同;因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大;因基金申购与赎回带来的现金变动;因指数编制机构指数编制错误等,由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

4、跟踪误差控制未达约定目标的风险:本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.20%以内,年化跟踪误差控制在2%以内,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、成份券停牌或违约的风险:标的指数成份券可能因各种原因临时或长期停牌或发生违约,发生成份券停牌或违约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)停牌成份券可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。(3)若成份券停牌时间较长,在约定时间内仍未能及时买入或卖出的,则该部分款项将按照约定方式进行结算(具体见招募说明书“基金份额的申购与赎回”之“申购赎回清单的内容与格式”相关约定),由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。(4)在极端情况下,标的指数成份券可能大面积停牌或违约,基金可能无法及时卖出成份券以获取足额的符合要求的赎回对价,由此基金管理人可能根据基金合同的约定在申购赎回清单中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、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内向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、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。投资人将面临转换运作方式、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期间,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。

7、标的指数变更的风险:尽管可能性很小,但根据基金合同规定,如出现变更标的指数的情形,本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变,投资组合将随之调整,基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致,投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

8、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险:尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内,但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响,存在不同于基金份额净值的情形,即存在价格折溢价的风险。

9、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险:基金上市交易后,基金管理人将根据基金的运作情况决定是否进行本基金基金份额参考净值的计算与公告,并将提前公告。IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异,与投资者申购赎回的实际结算价格也可能存在差异,IOPV计算也可能出现错误。投资人若参考IOPV进行投资决策可能导致损失。

10、投资者申购失败的风险:如果投资者申购时未能提供符合要求的申购对价,或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的申购申请,则投资者的申购申请失败。基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置并调整申购份额上限,如果一笔新的申购申请被确认成功会使本基金当日申购份额超过申购赎回清单中规定的申购份额上限时,该笔申购申请将被拒绝。

11、投资人赎回失败的风险:如果投资人提出赎回申请时持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金,或者基金投资组合中不具备足额的符合要求的赎回对价,或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者赎回申请,则投资者的赎回申请失败。基金管理人可能根据成份券市值规模等因素调整最小申购赎回单位,由此可能导致投资人按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额,可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回,而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。基金管理人可根据市场情

况在申购赎回清单中设置并调整赎回份额上限,如果一笔新的赎回申请被确认成功会使本基金当日赎回份额超过申购赎回清单中规定的赎回份额上限时,该笔赎回申请将被拒绝。基金管理人可能在申购赎回清单中设置极低的赎回份额上限,投资人将面临无法赎回全部或部分份额的风险。

12、基金管理人代理申赎投资者买券卖券带来的风险:因涉及组合证券的买卖,在投资者申购、赎回本基金时,本基金组合证券需以一定数量的现金进行替代,并由基金管理人按照招募说明书约定代理申赎投资者进行相关证券买卖,投资者需承受买入证券的结算成本和卖出证券的结算金额的不确定性的风险。由于指数成份券采取基金管理人代买代卖模式,可能给投资者申购和赎回带来价格的不确定性,而这种价格的不确定性可能影响本基金二级市场价格的折溢价水平。投资人在赎回基金份额时,基金投资组合变现可能受到市场变化、部分成份券停牌或流动性不足等因素影响,导致投资者收到的赎回对价可能延期交收或赎回对价的金额出现较大波动的风险。此外,基金管理人可根据运作情况调整代理申赎投资者买券卖券的相关规则,存在相关规则变动带来的风险。

13、退市风险:因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市,或被基金份额持有人大会决议提前终止上市,导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

14、投资资产支持证券的风险:(1)与基础资产相关的风险主要包括特定原始权益人破产风险、现金流预测风险等与基础资产相关的风险。(2)与资产支持证券相关的风险主要包括资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、资产支持证券的流动性风险、评级风险等与资产支持证券相关的风险。(3)其他风险主要包括政策风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险。

15、投资国债期货的风险:本基金可投资国债期货,所面临的风险如下:(1)杠杆性风险。国债期货交易采用保证金交易方式,潜在损失可能成倍放大,具有杠杆性风险。(2)到期日风险。国债期货合约到期时,如本基金仍持有未平仓合约,交易所将按照交割结算价将本基金持有的合约进行现金交割,本基金存在无法继续持有到期合约的可能,具有到期日风险。国债期货合约采取实物交割方式,如本基金未能在规定期限内如数交付可交割国债或者未能在规定期限内如数缴纳交割货款,将构成交割违约,交易所将收取相应的惩罚性违约金。(3)强制平仓风险。如本基金参与交割不符合交易所或者期货公司相关业务规定,期货公司有权不接受本基金的交割申请或对本基金的未平仓合约强行平仓,由此产生的费用和结果将由基金承担。(4)使用国债期货对冲市场风险的过程中,基金财产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将期货合约展期时,合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性,面临跨期基差风险。

16、投资信用衍生品的风险:本基金可能投资信用衍生品,信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险。流动性风险是指信用衍生品在交易转让过程中因无法找到交易对手或交易对手较少,导致难以将信用衍生品以合理价格变现的风险。偿付风险是指在信用衍生品存续期间,由于不可控制的市场及环境变化,创设机构可能出现经营状况不佳或创设机构的现金流与预期发生一定偏差,从而影响信用衍生品结算的风险。价格波动风险是指由于创设机构或所受保护的债券主体经营状况或利率环境发生变化,引起信用衍生品价格出现波动的风险。

17、第三方机构服务的风险:本基金的多项服务委托第三方机构办理,存在以下风险:(1)申购赎回代理券商因多种原因,导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止,由此影响对投资人申购赎回服务的风险。(2)登记结算机构可能调整结算制度,如实施货银对付制度,对投资人基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化,制度调整可能给投资人带来风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。(3)证券/期货交易所、登记结算机构、基金托管人及其他代理机构可能违约,导致基金或投资人利益受损的风险。

其他风险:市场风险、基金管理风险、流动性风险、其他风险、本基金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。

（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]

- 《天弘中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 《天弘中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 《天弘中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数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