

天弘基金管理有限公司关于天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金之C类基金份额开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告

公告送出日期:2022年5月27日

1 公告基本信息		
基金名称	天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中债1-3年国开行债发起	
基金主代码	008933	
基金运作方式	契约开放式,发起式	
基金合同生效日	2020年4月13日	
基金管理人名称	天弘基金管理有限公司	
基金托管人名称	兴业银行股份有限公司	
基金注册登记机构名称	天弘基金管理有限公司	
公告依据	《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等相关法律法规以及《天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金基金合同》、《天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金招募说明书》等相关文件	
申购起始日	2022年5月27日	
赎回起始日	2022年5月27日	
转换转入起始日	2022年5月27日	
转换转出起始日	2022年5月27日	
定期定额投资起始日	2022年5月27日	
下属分级基金的基金简称	天弘中债1-3年国开行债发起A	天弘中债1-3年国开行债发起C
下属分级基金的交易代码	008933	015791
是否开放基金申购、赎回、转换、定期定额投资	—	是

注:天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金自2022年5月27日起增投C类基金份额,原有的基金份额自动转换为A类基金份额,A类基金份额已于2020年5月20日起开放日常申购、赎回业务,具体请参见本公司已披露的相关公告。

2.本基金C类基金份额日常申购、赎回业务的办理时间
投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的约定可暂停申购、赎回业务,届时将另行公告。

基金合同生效后,若出现新的证券市场,证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

3.本基金C类基金份额的日常申购业务
3.1申购金额限制
(1)通过本公司网上系统及其他销售机构的首次申购单笔最低金额为人民币10.00元(含申购费,下同),追加申购单笔最低金额人民币10.00元,通过本公司直销中心(不含网上直销系统)的首次申购单笔最低金额为10,000.00元,追加申购的单笔最低金额1,000.00元,收益分配份额时,不受最低申购金额的限制,新增销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有规定的,以各销售机构的业务规定为准。
(2)基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额的限制,或者新增规模控制措施,基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

3.2申购费率
C类基金份额不收取申购费用。
4.本基金C类基金份额的日常赎回业务
4.1赎回份额限制
(1)基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回,单笔赎回不得少于10份,某笔赎回导致基金份额持有人持有该销售机构全部交易账户持有的基金份额少于10份的,基金管理人有权强制赎回基金份额持有人持有在该销售机构全部交易账户持有的基金份额,如红利再投资、非交易过户、转托管、巨额赎回、基金转换等原因导致的账户余额少于10份之情况,不受此限,但再次赎回时必须一次性全部赎回。
(2)基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定赎回份额的限制,或者新增规模控制措施,基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4.2赎回费率
本基金C类基金份额的赎回费率具体如下表所示:

持有期限 (天)	赎回费率
T ≤ 7	1.50%
7天 ≤ T	0%

C类基金份额收取的赎回费全额计入基金财产。
5.本基金C类基金份额的日常转换业务
5.1转换费率
基金转换费用由转出基金的赎回费和基金转换的申购补差两部分构成,具体收取情况视每次转换时不同基金的申购费率和赎回费率的差异情况而定。

5.2其他与转换相关的事项
(1)投资者办理本基金日常转换业务时,基金转换费用计算方法、业务规则按照基金管理人于2014年12月15日披露的《天弘基金管理有限公司关于公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告》执行。
(2)转换业务适用的销售机构
投资者可通过本公司直销机构(含直销中心、网上直销系统)办理相关基金转换业务,本基金其他销售机构是否支持转换业务,具体转换规则及相关优惠活动以销售机构规定为准。

6.本基金C类基金份额的定期定额投资业务
6.1“定期定额投资业务”是指投资者通过本公司指定的销售机构申请,约定每期申购日、扣款金额,扣定期定额投资业务方式,由指定销售机构于每期约定扣款日,在投资人指定银行账户内自动完成扣款和受理基金申购申请的一种投资方式。
定期定额申购费率与普通申购费率一般情况下相同,但在基金促销活动期间,基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低定期定额申购费率或免收申购费。
销售机构将按照投资者申请时所约定的每期约定扣款日、扣款金额扣款,每期扣款金额必须不低于基金管理人公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额,若遇非基金交易时,扣款是否顺延以销售机构的具体规则为准。

6.2定期定额投资业务适用的销售机构
投资者可通过本公司直销机构(含直销中心与网上直销系统)办理相关基金定期定额投资业务,本基金其他销售机构是否支持定期定额投资业务,具体业务办理规则及相关优惠费率请以销售机构规定为准。

7.本基金C类基金份额的销售机构
7.1直销机构:天弘基金管理有限公司(含直销中心与网上直销系统)
7.2其他销售机构
麒麟基金、天天基金、同花顺、好买基金、创金启元、玄元保险、玄斧子、和鼎传承、万家财富、肯特理、诺亚正行、基煜基金、蚂蚁财富、蛋卷基金、宜信基金、新浪金石、嘉实财富、盈米基金、上海大智慧、阳光人寿、泰信财富、大连网金。

基金管理人可综合各种情况增加或者减少销售机构,并进行公告或在基金管理人网站进行公示,各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异,具体请以各销售机构的规定为准。
8.本基金C类基金份额净值公告的披露安排
在开始办理基金份额申购或赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点披露开放日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。
基金管理人应当在不晚于中期和年度最后一日,在指定网站披露中期和年度最后一日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

9.其他需要提示的事项
(1)本公告仅对天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的有关事项予以说明,投资者欲了解本基金的详细情况,请仔细阅读基金相关法律文件。
(2)基金销售机构对申购等业务申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请,申请的确认以登记机构的确认结果为准,对于申请的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使合法权利。
(3)基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整申购费率、赎回费率和收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
(4)上述申购业务规则仅适用于基金申购业务及定期定额投资申购业务,赎回业务规则包括转换业务,但尚未开通或暂停上述业务的情形除外。
(5)有关本基金开放申购、赎回等业务的具体规定若发生变化,基金管理人将另行公告。
(6)投资者可登录我公司官方网站(www.thfund.com.cn)或拨打我公司客户服务热线(95046)了解本基金的有关情况。

风险提示
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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益,投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》等相关法律文件。
特此公告。

天弘基金管理有限公司
二〇二二年五月二十七日

天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要(更新)

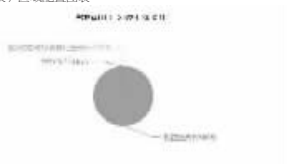
送出日期:2022年5月27日

编制日期:2022年5月28日

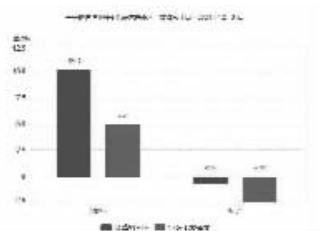
本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分,作出投资决策前,请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况			
基金简称	计算机ETF	基金代码	159998
基金管理人	天弘基金管理有限公司		
基金合同生效日	2020年3月20日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2020年4月13日
基金类别	股票型	交易币种	人民币
运作方式	交易型开放式	开放频率	每个开放日一次
基金经理1	张子法	开始担任本基金基金经理的日期	2020年3月20日
基金经理2	林心尧	开始担任本基金基金经理的日期	2007年12月28日
其他	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90个工作日出现前述情形的,本基金应当按照本基金合同的约定程序进行清算并终止,且无需召开基金份额持有人大会,法律法规另有规定的除外,届时将另行公告。	最近日期	2022年4月25日
---基金投资与申报披露 (一) 投资目标与投资策略			
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度绝对值控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。		
投资范围	本基金以标的指数的成份股、备选成份股为主要投资对象,此外,为更好地实现基金的投资目标,本基金还可投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的中国股票),存托凭证,债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等),货币市场工具,资产支持证券,债券回购,资产支持证券,银行存款,股指期货以及法律法规和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。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资融券及转融通证券出借业务,基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股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%,每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规及监管机构的规定执行,而法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。		
主要投资策略	本基金主要采用完全复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当期成份股发生调整和成份股发生增发、分红、送转、分拆等事件时,或因基金的申购和赎回造成基金仓位偏离目标仓位可能带来影响时,或因某些特殊情况(如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等)导致流动性不足时,或其他原因导致无法复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理方法适当调整,从而使得投资组合资产能够跟踪标的指数。本基金管理人对于投资组合更紧密跟踪标的指数,基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品,股指期货及其他与标的指数或成份股相关的股指期货及其他产品,本基金产品投资策略仍包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资融券及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等策略。		
业绩比较基准	中证计算机主题指数收益率		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,本基金采用中证计算机主题指数的表现,其与沪深300指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。		
注:详见《天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》第一部分“基金的投资”。			

(二)投资组合资产配置图表/区域配置图表



(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:计算机ETF 2020年的净值增长率按照当年的实际存续期计算。

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	份额(M) 持有期限(N)	收费方式 费率	备注
申购费	投资者在申购基金份额时,申购赎回代理券商可按照不超过0.5%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	投资者在赎回基金份额时,申购赎回代理券商可按照不超过0.5%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: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。

投资者在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理券商可按照不超过0.5%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。

(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/费率
管理费	0.5%
托管费	0.1%
其他费用	包括信息披露费、会计师费、律师费、公证费、诉讼费、仲裁费等。

注:本基金交易所证券、基金等产生的费用和税金,按实际发生额从基金资产中扣除。

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。

1. 特有风险: (1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险。标的指数并不能完全代表整个股票市场,标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。(2) 标的指数波动的风险。标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、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。以下因素可能导致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股或变更权重,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) 由于标的指数成份股发生送配股、增发等行为导致成份股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) 成份股派发现金红利、成份股增发、送配等所获收益可能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; 4) 由于成份股停牌、停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用的存在,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,都会对本基金收益产生影响,从而影响本基金跟踪标的指数的跟踪程度; 7) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制,基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票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跟踪误差成本较大;因基金申购与赎回带来的现金变动;因指数发布机构指数编制错误等,由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。(4) 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策略将会改变,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。(5) 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0.2%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。(6) 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) 停牌成份股可能因其权重占比,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折溢价水平; 3) 若成份股停牌时间较长,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对价,由此基金管理人可能在中断赎回赎回中投资成份股的赎回份额上做出投资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。(7) 成份股退市的风险。标的指数成份股发生负面事件而面临退市风险,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。(8) 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,在一个工作日内召集基金份额持有人大会,商讨解决方案,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,基金管理人应依据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。(9) 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,即在交易价格折溢价的风险。(10) IOPV计算错误的风险。深圳证券交易所发布基金份额参考净值(IOPV),供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考,IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异,IOPV计算也可能出现错误。投资者若参考IOPV进行投资决策可能导致损失。(11) 投资者申购失败的风险。本基金的申购赎回清单中,可能仅允许对部分成份股使用现金替代,且设置了现金替代比例上限;此外,对于场内申购赎回部分的上交所成份券,也将使用现金替代。因此,投资者在进行申购时,可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股,导致申购失败的风险。(12) 投资者赎回失败的风险。基金管理人可能根据成份股市值波动变化等因素调整最小申购赎回单位,由此可能导致投资者持有的基金份额,可能无法按照最小申购赎回单位赎回,同时,在投资者提交赎回申请时,如本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价,也可能导致出现赎回失败的情形。(13) 基金份额赎回对价的变现风险。本基金赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额等。在组合证券变现过程中,由于市场变化,部分成份股流动性差等因素,导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异,存在变现风险。(14) 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。(15) 投资于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评级下调措施相关风险、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。(16) 基金参与融资与转融通证券出借业务的风险。本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资及转融通证券出借业务,可能存在如下特有风险: 1) 流动性风险: 本基金面临大额赎回时可能因转融通证券出借的原因,发生无法及时变现并支付赎回款项的风险; 2) 信用风险: 转融通证券出借的对手方可能无法及时归还出借证券,无法及时支付权益补偿及相关费用的风险; 3) 市场风险: 证券出借后,可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险; (17) 第三方机构服务风险: 本基金的多数服务委托第三方机构办理,存在以下风险: 1) 申购赎回代理机构因多种原因,导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止,由此影响对投资者申购赎回服务的风险; 2) 登记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。(18) 基金合同自动终止的风险。(基金合同)生效后,连续60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,本基金应当按照本基金合同的约定程序进行清算并终止,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可能自动终止的风险。(19) 存托凭证投资风险。本基金可投资存托凭证,基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响,存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

2. 其他风险: 本基金产品仍存在市场风险、基金管理风险、流动性风险、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及其他风险。

(二)重要提示

中国证监会对本基金募集的注册,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。因此本文件中内容相与基金的实际情况可能存在一定的滞后,如能及时、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]

●《天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

●《天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

●《天弘中证计算机主题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