

# 天弘季季兴三个月定期开放债券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11月13日

送出日期: 2024年11月14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    | 天弘季季兴三个月定期开放债券发起   | 基金代码           | 008644       |
| 基金简称A   | 天弘季季兴三个月定期开放债券发起A  | 基金代码A          | 008644       |
| 基金管理人   | 天弘基金管理有限公司   | 基金托管人          | 国泰君安证券股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2019年12月17日  |                |              |
| 基金类型    | 债券型  | 交易币种           | 人民币          |
| 运作方式    | 定期开放式  | 开放频率           | 每三个月开放一次     |
| 基金经理    | 柴文婷  | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2019年12月17日  |
|         |  | 证券从业日期         | 2011年07月11日  |
| 其他      | 本基金的基金合同生效之日起三年后的对应日,若基金资产净值低于两亿元的,本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止,无需召开基金份额持有人大会审议,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、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。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;连续五十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,而无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。 |                |              |

## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

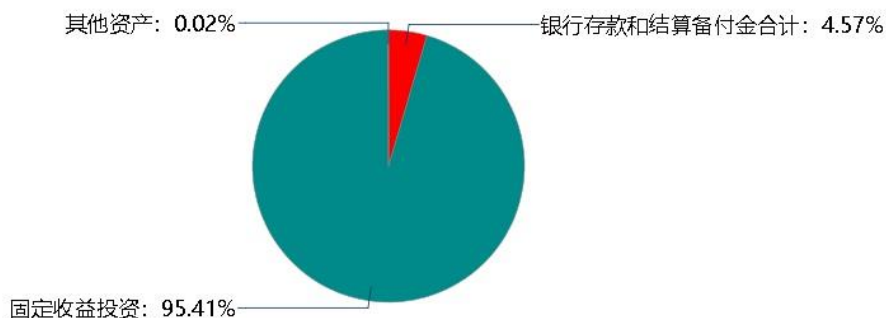
|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 在有效控制投资组合风险的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。  |
| 投资范围 | 本基金投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括债券(国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、可分离交易可转债的纯债部分、公开发行的次级债)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相 |

|               |  |
|---------------|--|
|               | 关规定)。本基金不投资于股票,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。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的80%,但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期开始前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制。开放期内,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;在封闭期内,本基金不受上述5%的限制;其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。   |
| <b>主要投资策略</b> | <p>1、封闭期投资策略:本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法,确定资产在非信用类固定收益类证券和信用类固定收益类证券之间的配置比例。发挥基金管理人长期积累的信用研究成果,利用自主开发的信用分析系统,深入挖掘价值被低估的标的券种,以获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括:期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、个券挖掘策略等。在谨慎投资的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。在以上战略性资产配置的基础上,本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法,进行前瞻性的决策。一方面,本基金将分析众多的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等),并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等。另一方面,本基金将对债券市场整体收益率曲线变化进行深入细致分析,从而对市场走势和波动特征进行判断。在此基础上,确定资产在非信用类固定收益类证券(现金、国家债券、中央银行票据等)和信用类固定收益类证券之间的配置比例。本基金灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、个券挖掘策略等,在合理管理并控制组合风险的前提下,最大化组合收益。</p> <p>2、开放期投资策略:开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种。</p> |
| <b>业绩比较基准</b> | 中债综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 90%+1年期定期存款利率(税后) $\times$ 10%  |
| <b>风险收益特征</b> | 本基金为债券型基金,预期风险和预期收益水平高于货币市场基金,但低于混合型基金和股票型基金。  |

注:详见《天弘季季兴三个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》"基金的投资"章节。

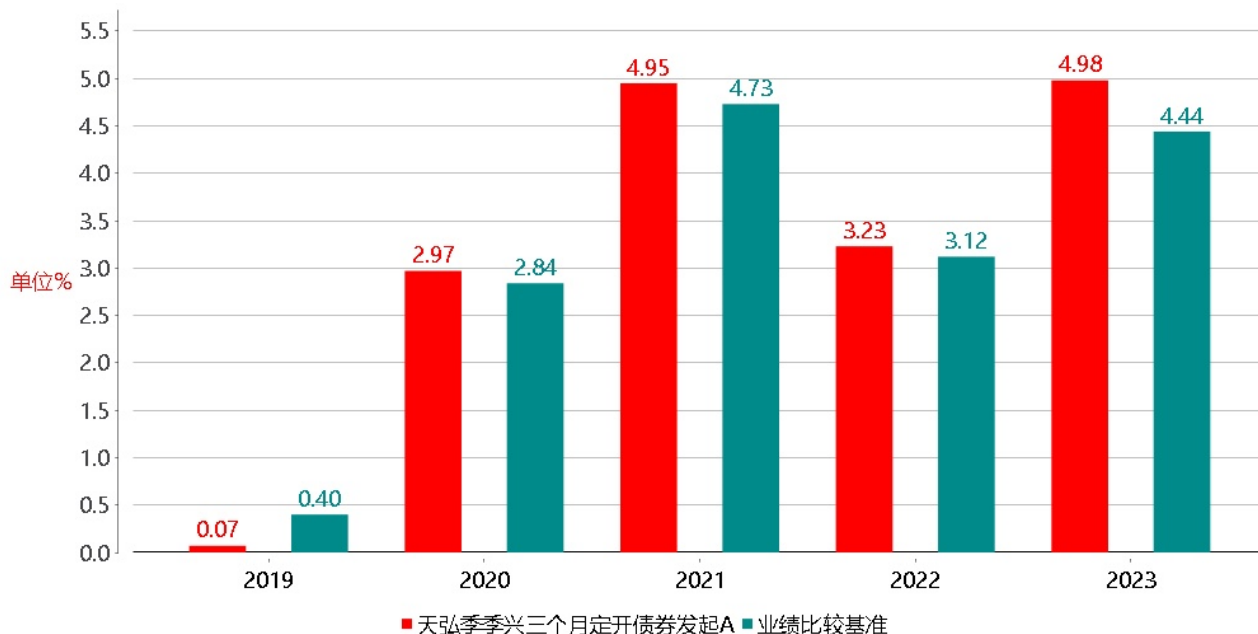
## (二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

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        | 0.50%   |    |
|      | 100万≤M<200万   | 0.30%   |    |
|      | 200万≤M<500万   | 0.15%   |    |
|      | 500万≤M        | 1000元/笔 |    |
| 赎回费  | N<7天          | 1.50%   |    |
|      | 7天≤N<30天      | 0.10%   |    |
|      | 30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   | 0.30%                 | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费   | 0.10%                 | 基金托管人      |
| 审计费用  | 70,000.00 元           | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 100,000.00 元          | 规定披露报刊     |
| 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：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） |
|--------------|
| 0.44%        |

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本基金每三个月开放一次申购和赎回，投资者需在开放期提出申购赎回申请，在封闭期内将无法进行申购和赎回。②开放期如果出现较大数额的净赎回申请，则使基金资产变现困难，基金可能面临一定的流动性风险，存在着基金份额净值波动的风险。③基金合同生效三年后的对应日，若本基金基金资产净值低于两亿元，基金合同自动终止，且无需召开基金份额持有人大会审议。《基金合同》生效后继续存续的，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元情形的，基金合同应当终止，并按照基金合同的约定程序进行清算，且无需召开基金份额持有人大会。④特定机构投资者大额赎回导致的风险。1) 特定机构投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险。如果特

定机构投资者大额赎回，可能会导致基金份额净值波动的风险。主要原因是，根据本基金招募说明书和基金合同的规定，基金份额净值的计算精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入，当特定机构投资者巨额赎回时，由于基金份额净值四舍五入产生的误差计入基金财产，导致基金份额净值发生大幅波动。基金份额净值计算符合基金合同和法律法规的相关规定，单日大幅波动是在现有估值方法下出现的特殊事件。2) 特定机构投资者大额赎回导致的流动性风险。如果特定机构投资者大额赎回，为应对赎回，可能迫使基金以不适当的价格大量抛售证券，使基金的净值增长率受到不利影响。3) 特定机构投资者大额赎回导致的巨额赎回风险如果特定机构投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定延缓支付赎回款项或延期办理赎回申请。4) 特定机构投资者大额赎回导致的基金资产净值较低的风险。《基金合同》生效三年后继续存续的，如果特定机构投资者大额赎回导致基金资产净值较低，可能出现净值低于5000万元的情形，继而触发基金合同终止条件导致基金无法继续存续。

2、其他风险：普通债券型证券投资基金共有风险，如市场风险、启用侧袋机制的风险、流动性风险、基金投资特定品种可能引起的风险、操作风险、管理风险、合规性风险、税负增加风险、其他风险等。

## （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]

- 《天弘季季兴三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 《天弘季季兴三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 《天弘季季兴三个月定期开放债券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