

天弘纳斯达克100指数型发起式证券投资基金（QDII）（D类份额）基金  
产品资料概要（更新）

编制日期：2025年06月26日

送出日期：2025年06月27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    | 天弘纳斯达克100指数发起（QDII）                                                                                                                                                                                                              | 基金代码           | 018043       |
| 基金简称D   | 天弘纳斯达克100指数发起（QDII）D                                                                                                                                                                                                             | 基金代码D          | 022525       |
| 基金管理人   | 天弘基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                       | 基金托管人          | 平安银行股份有限公司   |
| 基金合同生效日 | 2023年04月11日                                                                                                                                                                                                                      | 境外托管人          | 美国花旗银行股份有限公司 |
| 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1   | 胡超                                                                                                                                                                                                                               | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023年04月11日  |
|         |                                                                                                                                                                                                                                  | 证券从业日期         | 2013年06月17日  |
| 基金经理2   | LIU DONG（刘冬）                                                                                                                                                                                                                     | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023年04月11日  |
|         |                                                                                                                                                                                                                                  | 证券从业日期         | 2003年09月01日  |
| 其他      | 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》生效满三年后继续存续的，连续二十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，基金管理人应当按照基金合同的约定程序进行清算并终止基金合同，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。 |                |              |

注：自2024年11月01日起，增设天弘纳斯达克100指数型发起式证券投资基金（QDII）D类份额。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

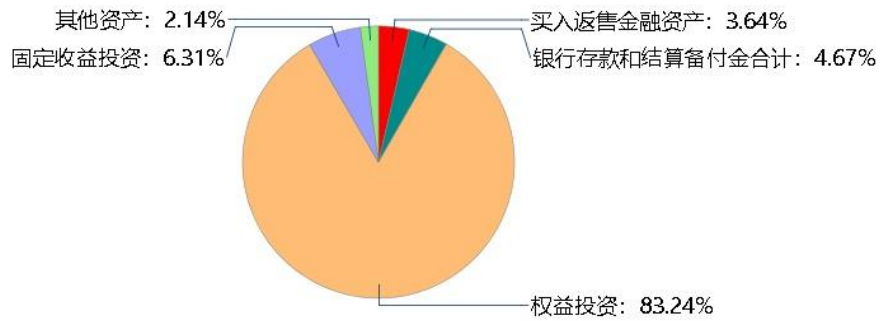
|      |                                                                                                                                 |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。                                                                                  |
| 投资范围 | 本基金的标的指数为纳斯达克100指数（使用估值汇率折算）。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于在境内外市场依法发行的金融工具。针对境外市场，本基金可投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券以及银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等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相关规定）。针对境内市场，本基金可投资于债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会许可的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，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比例不低于基金资产的80%；本基金投资标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除境外金融衍生品需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者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。如法律法规或中国证监会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。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金主要采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因基金规模而投资受限，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。主要投资策略包括：大类资产配置、股票投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 业绩比较基准 | <p>纳斯达克100指数收益率（使用估值汇率折算）×95%+人民币活期存款收益率（税后）×5%</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

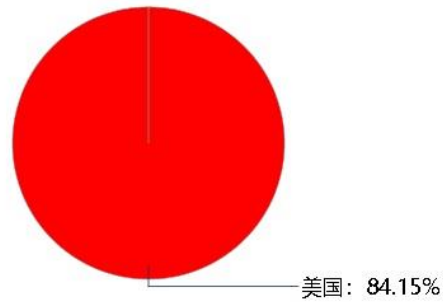
注：详见《天弘纳斯达克100指数型发起式证券投资基金（QDII）招募说明书》"基金的投资"章节。

## （二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日期：2025年03月31日



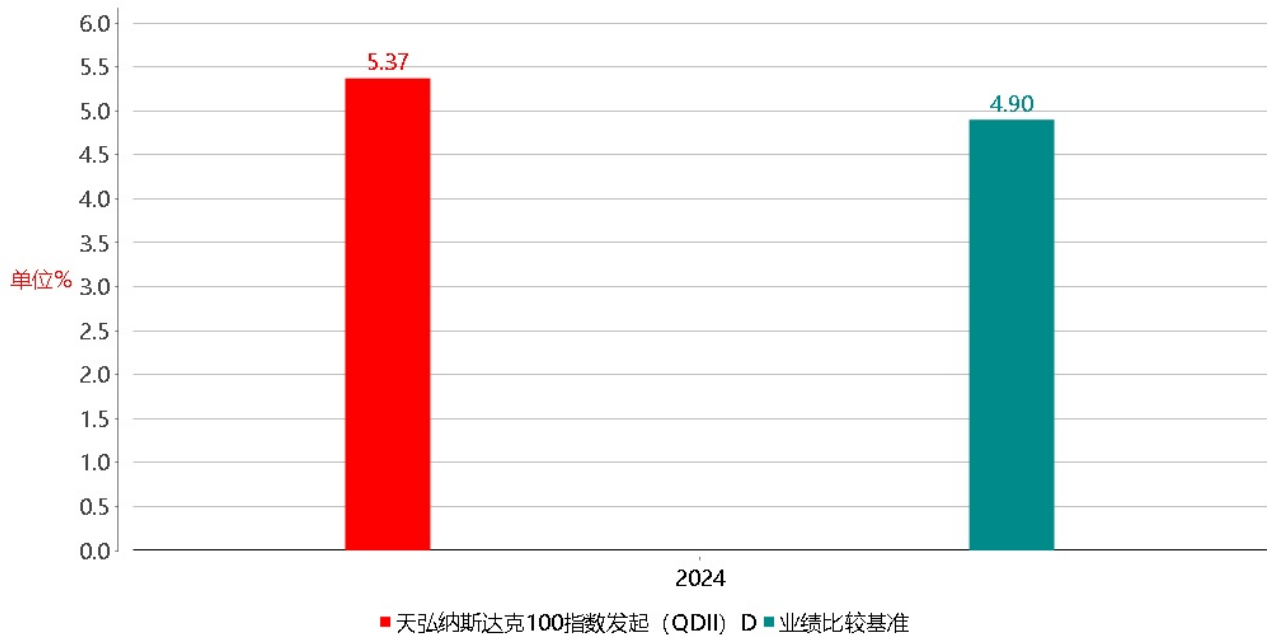
数据截止日期：2025年03月31日



注：图示为本基金在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资占本基金在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资之和的比重；图示比例为本基金在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资占基金资产净值比例。

（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：2024年12月31日  
本基金份额增设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  | -                         | -       |    |
| 赎回费  | $N < 7$ 天                 | 1.50%   |    |
|      | $7\text{天} \leq N < 30$ 天 | 1.00%   |    |
|      | $30\text{天} \leq N$       | 0.00%   |    |

注：天弘纳斯达克100指数发起（QDII）D不收取申购费用。

#### (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   | 0.50%                 | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费   | 0.10%                 | 基金托管人      |
| 销售服务费 | 0.20%                 | 销售机构       |
| 审计费用  | 90,000.00 元           | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 120,000.00 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） |
|--------------|
| 0.81%        |

注：基金管理费率、托管费率、销售服务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）宏观经济风险。经济成长放缓或利率抬升可能会影响基金所投资之特定地域或市场的公司股价。

（2）政策风险。基金所投资之特定地域或市场可能会采用自由化的经济政策，这一趋势的逆转将影响该地域或市场的风险溢价。

（3）价格管制风险。特定市场政府可能会对某些资产进行价格控制，并可能在未来对商品或服务采取价格管控行为，这可能会对投资公司的利润产生不利影响。

（4）股票市场管制风险。所投市场对于股市的监管可能发生变化，当地监管机构可能会引入对交易成本和自由度产生不利影响的监管措施。

（5）地缘政治风险。地缘政治风险向来被认为是影响世界经济不稳定的因素，偶发性的地域冲突，或受到全球恐怖主义威胁的影响，此风险于拟投资的市场并不常见，但是地缘政治的不稳定性可能会影响该市场的股票价格。

（6）信用评级下调的风险。任何地域市场的主权评级下调，都将影响该地域或市场的投资的风险溢价。

（7）外汇风险。作为原材料的进口国及人力资源、货物和服务的出口国，任何外汇市场的波动都可能影响基金投资的价值。

（8）外汇管制风险。政府为平衡国际收支和维持本国货币汇率有可能对外汇进出实行的限制性措施，任何限制性措施都将影响外汇市场进而影响基金投资的价值。

（9）本基金是股票型指数基金，原则上主要采用完全复制法跟踪本基金的标的指数，基金在多数情况下将维持较高的股票投资比例，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

（10）标的指数风险。即编制方法可能导致标的指数的表现与总体市场表现的差异，此外因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。

（11）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、投资者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。

（12）跟踪偏离风险。即基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与标的指数表现之间产生差异的不确定性。

（13）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，如果指数编制机构变更或停止该指数的编制及发布、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数。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。

(14) 跟踪误差控制未达约定目标的风险。在正常市场情况下，本基金力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，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。

(15) 成份股停牌的风险。

(16) 成份股退市的风险。

(17) 指数编制机构停止服务的风险。

(18) 若基金管理人同时管理跟踪同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金(ETF)，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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。

(19) 基金合同自动终止的风险。

2、其他风险：海外投资的特殊风险（海外市场风险、汇率风险、政治风险、法律和政府管制风险、会计核算风险、税务风险、信用风险、交易结算风险、法律风险）、开放式基金风险（流动性风险、管理风险、大额赎回风险、金融模型风险、衍生品投资风险、境外证券借贷、正回购/逆回购风险、投资境内资产支持证券的风险、投资流通受限证券的风险、境外存托凭证投资风险、操作风险、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、其它风险）。

## （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]

- 《天弘纳斯达克100指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》
- 《天弘纳斯达克100指数型发起式证券投资基金（QDII）托管协议》
- 《天弘纳斯达克100指数型发起式证券投资基金（QDII）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