天弘中证科创创业 50 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:国泰君安证券股份有限公司

重要提示

1.天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)于 2021 年 9 月 30 日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可【2021】3182 号)。

2.本基金类别为股票型证券投资基金,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”),基金托管人为国泰君安证券股份有限公司,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 2022 年 3 月 29 日至 2022 年 6 月 28 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股票认购三种方式。

6.本基金管理人可办理网下现金发售和网下股票发售。

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股票认购发售代理机构为中信证券等销售机构,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账户,即在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳 A 股账户或深圳证券投资基金账户。深圳证券投资基金账户只能进行基金份额的网上现金认购、网下现金认购及二级市场交易,如投资人以深圳证券交易所上市交易的本基金标的指数成份股或备选成份股进行网下股票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;如投资人以上海证券交易所股票进行网下股票认购的,除了持有深圳证券账户外,还应持有上海 A 股账户,且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资者所有,用以认购基金份额的托管证券公司和上海 A 股账户指定交易证券公司还应为同一发售代理机构。已购买过由天弘基金管理有限公司担任登记机构的基金的投资人,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 0.80%。

11.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。

12.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。投资人以股票认购的,认购股票按照交易所和登记机构的规则和流程办理股票的冻结与过户,最终将投资人申请认购的股票过户至基金证券账户。投资人的认购股票过户至基金证券账户日(不含)的冻结期间的权益归投资人所有。

13.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《天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

14.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。

15.本公司可综合各种情况对本基金的发售安排做适当调整,并可根据基金销售情况适当延长、缩短或调整基金发售时间,并及时公告。

16.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。

本基金标的指数为中证科创创业 50 指数。

1、指数样本空间

中证科创创业 50 指数的样本空间由满足以下条件的科创板和创业板上市的股票和红筹企业发行的存托凭证组成:

(1)上市时间超过一个季度,除非该证券自上市以来的日均总市值在沪深市场中排名前 30 位;

(2)非 ST、*ST 证券。

2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 80%。

3、选样方法

(1)对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券,选取新一代信息技术产业、高端装备制造产业、新材料产业、生物产业、新能源汽车产业、新能源产业、节能环保产业、数字创意产业等新兴产业上市公司证券作为待选样本;

(2)将待选样本按照过去一年日均总市值由高到低排名,选取排名前 50 的证券作为指数样本。

4.指数采用调整市值加权,并设置权重因子,权重因子介于 0 和 1 之间,以便单个样本权重不超过 10%,单个板块权重占比不超过 80%。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站,网址:www.csindex.com.cn。

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。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书,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:标的指数的风险,基金投资组合回报与标的数回报偏离的风险、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、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份股停牌的风险、成份股退市的风险、指数编制机构停止服务的风险等等。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。

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。本基金通过办理场内申购赎回的,投资者的申购、赎回申请在 T 日确认,申购所得 ETF 份额 T 日可竞价卖出,T+1 日可赎回或者大宗卖出;赎回所得的组合证券当日可竞价卖出,T+1 日可用于申购 ETF 份额或大宗卖出。办理场外组合证券申购赎回的,投资者的申购、赎回申请在 T+1 日确认,申购所得 ETF 份额及赎回所得组合证券在 T+2 日可用。如投资者需要通过申购赎回代理券商参与本基金的场内申购赎回,则应开立深圳证券交易所 A 股账户。如投资者需要通过申购赎回代理券商参与本基金的场外组合证券申购赎回,则应同时持有并使用深圳 A 股账户与上海 A 股账户,且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资者所有,同时用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海 A 股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商。本基金暂时不开通场外组合证券申购赎回业务,若基金管理人日后开通该申赎模式的,将提前发布公告,且无须召开基金份额持有人大会。

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,采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的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。

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:天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金

场内简称:双创龙头 ETF

基金代码:159603

(二)基金类型和运作方式

本基金类型为股票型证券投资基金,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,认购价格为 1.00 元。

(五)募集目标

本基金基金募集份额总额不少于 2 亿份,基金募集金额(含网下股票认购所募集的股票市值)不少于 2 亿元人民币。

(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 2022 年 3 月 29 日至 2022 年 6 月 28 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(含网下股票认购所募集的股票市值)不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 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 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。网下股票认购所募集的股票由发售代理机构予以冻结。

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 日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息。对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票,发售代理机构应予以解冻。如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。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。

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:韩歆毅

成立时间:2004 年 11 月 8 日

客服电话:95046

(二)基金托管人

名称:国泰君安证券股份有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址:上海市静安区新闸路 669 号博华广场 19 楼

法定代表人:贺青

成立时间:1999 年 8 月 18 日

客服电话:95521、4008888666

(三)销售机构

1.网下现金发售直销机构和网下股票发售直销机构

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:韩歆毅

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、安信证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、长城证券、长江证券、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、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、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、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、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、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、九州证券、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、申万宏源证券、申万宏源西部证券、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、网信证券、西部证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、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、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)中信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

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

客服电话:95558

网址:www.cs.ecitic.com

(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:冯恩新

电话:0532-85022326

联系人:焦刚

客服电话:95548

网址:sd.citics.com

(3)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:胡伏云

联系人:陈靖

联系电话:020-88836999

客服电话:95396

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:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址:上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人:李丹

电话:(021)23238888

经办注册会计师:张振波、林佳璐

联系人:林佳璐

十、网下股票认购清单

本基金募集期间,网下股票认购名单如下表所示,但是募集期结束前已公告的将被调出中证科创创业 50 指数的成份股不得用于认购本基金。基金管理人可根据网下股票认购日前 3 个月的个股的交易量、价格波动及其他异常情况,决定是否对个股认购规模进行限制,并在网下股票认购日前至少 3 个工作日公告限制认购规模的个股名单。对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股,基金管理人可不经公告,全部或部分拒绝该股票的认购申报。

证券代码	证券名称	证券代码	证券名称	证券代码	证券名称
300003	乐普医疗	300628	亿联网络	688180	君实生物
300014	亿纬锂能	300661	圣邦股份	688185	康希诺
300122	智飞生物	300676	华大基因	688187	时代电气
300124	汇川技术	300750	宁德时代	688256	寒武纪
300142	沃森生物	300751	迈为股份	688303	大全能源
300207	欣旺达	300759	康龙化成	688396	华润微
300223	北京君正	300760	迈瑞医疗	688521	芯原股份
300274	阳光电源	300782	卓胜微	688538	和辉光电
300316	晶盛机电	300832	新产业	688561	奇安信
300347	泰格医药	300919	中伟股份	688599	天合光能
300408	三环集团	688008	澜起科技	688728	格科微
300433	蓝思科技	688009	中国通号	688772	珠海冠宇
300450	先导智能	688012	中微公司	688777	中控技术
300454	深信服	688036	传音控股	688819	天能股份
300496	中科创达	688111	金山办公	688981	中芯国际
300558	贝达药业	688126	沪硅产业	689009	九号公司
300601	康泰生物	688169	石头科技		

天弘基金管理有限公司
二〇二二年三月二十五日

天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要

编制日期:2022 年 3 月 24 日
送出日期:2022 年 3 月 25 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	双创龙头 ETF	基金代码	159603
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	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	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
基金经理 1	杨超	开始担任本基金基金经理的日期	暂无
		证券从业日期	2010 年 5 月 4 日
基金经理 2	林心龙	开始担任本基金基金经理的日期	暂无
		证券从业日期	2015 年 7 月 6 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 50 个工作日出现前述情形的,本基金应当按照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。法律法规或中国证监会另有规定时,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	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	本基金以标的指数成份股、备选成份股(含存托凭证)为主要投资对象。此外,为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括科创板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、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、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货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)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。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。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需缴纳的交易保证金后,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依照法律法规或监管机构的规定执行。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	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股权成及权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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,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(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,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。为使得基金的投资组合紧紧密地跟踪标的指数,基金可进行股指期货投资。主要产品投资策略包括: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	中证科创创业 50 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、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、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《天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》第十一部分“基金的投资”。	

(二)投资组合资产配置图表/区域配置图表

注:天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金无历史数据。

(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:天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金无历史数据。

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 万份	0.80%	
	50 万份≤M<100 万份	0.50%	
	M≥100 万份	每笔 1000 元	
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 0.5%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	投资人在赎回本基金时,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认购、申购本基金,认购、申购费率按每笔认购、申购申请单独计算。

认购、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
管理费	0.50%
托管费	0.10%
其他费用	包括信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等。
注:本基金父级证券、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。

本基金的特有风险:1.投资科创板股票的风险。本基金可投资于科创板股票,科创板股票在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他板块存在差异,本基金须承受投资于科创板上市公司相关的特有风险,包括但不限于:(1)科创板企业无法盈利甚至较大亏损的风险。(2)股价大幅波动风险。(3)流动性风险。(4)红筹企业的投资风险。(5)科创板企业退市风险。(6)科创板股票在发行与交易机制上与主板市场存在差异的风险。(7)监管规则变化的风险。科创板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则,可能根据市场情况进行修改完善,或者补充制定新的法律法规和业务规则,导致基金投资运作产生相应调整变化。(8)科创板长期投资者相关制度的风险。(9)科创板设立和注册制试点时间较短的风险。2.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。3.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。4.基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险。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.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向中国证监会报告并提出解决方案,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.成份股停牌的风险。标的指数或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的折溢价水平。(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。8.成份股退市的风险。标的指数成份股发生摘牌退市情况,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,指此制定成份股替代策略,并对投资组合进行相应调整。9.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。10.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。11.参考 IOPV 决策和 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),供投资人交易、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,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。12.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。13.投资人赎回失败的风险。基金管理人可能根据成份股市值规模变化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。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。14.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。15.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。16.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。17.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对价的风险;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。18.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,由此影响对投资人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。19.基金合同自动终止的风险。《基金合同》生效后,连续 50 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。20.参与存托凭证的风险。基金资产可投资于存托凭证,会面临与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等差异带来的特有风险,包括但不限于创新企业业务持续能力和盈利能力等经营风险,存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险;存托协议自动约束存托凭证持有人的风险;存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险;存托凭证退市的风险;因多地上市造成存托凭证价格差异以及受境外市场影响交易价格大幅波动的风险;存托凭证持有人权益被摊薄的风险;已在境外上市的基础证券发行人,在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险;境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险等。

此外,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、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]

《天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

《天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

《天弘中证科创创业 50 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

天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告

天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同全文和招募说明书全文于 2022 年 3 月 25 日在本公司网站(www.thfund.com.cn)和中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)披露,供投资者查阅。如有疑问可拨打本公司客服电话(95046)咨询。

本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。请充分了解本基金的风险收益特征,审慎做出投资决定。

特此公告。

天弘基金管理有限公司
二〇二二年三月二十五日