

天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）（D类份额）基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024年10月31日

送出日期：2024年11月01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	天弘标普500发起（QDII-FOF）	基金代码	007721
基金简称D	天弘标普500发起（QDII-FOF）D	基金代码D	022523
基金管理人	天弘基金管理有限公司	基金托管人	中信银行股份有限公司
基金合同生效日	2019年09月24日	境外托管人	美国花旗银行股份有限公司
基金类型	混合型	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	胡超	开始担任本基金基金经理的日期	2019年09月24日
		证券从业日期	2013年06月17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，本基金合同自动终止，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情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当按照本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，增设天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）D类份额。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

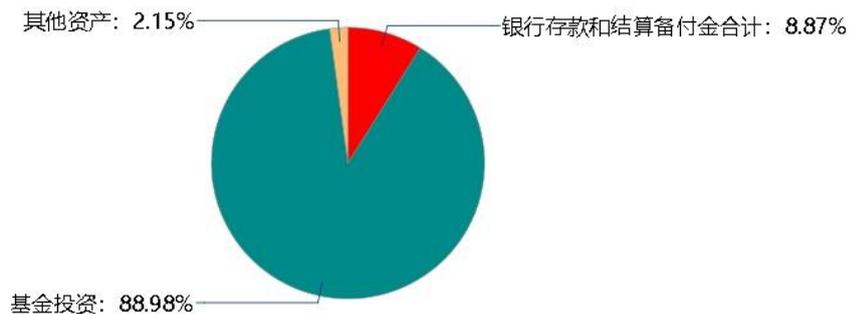
投资目标	在严格控制组合风险的基础上，主要投资于跟踪标普500指数的基金（含ETF），力争实现对标普500指数走势的有效跟踪。
投资范围	针对境外市场，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公开募集证券投资基金（以下简称“公募基金”，包含交易型开放式基金ETF）；普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；金

	融衍生产品（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）、结构性投资产品（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产品）以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。针对境内市场，本基金的投资范围包括境内具有良好流动性的金融工具，包括债券（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。本基金的投资组合比例为：投资于基金的比例不低于基金资产的80%。本基金投资于标普500指数基金的比例不低于本基金非现金资产的80%；持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例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。就基金合同而言，标普500指数基金是指全球范围内跟踪标普500指数的公募基金（包含ETF）。
主要投资策略	本基金将根据宏观分析进行资产配置，并通过全球范围内精选基金构建组合，以达到预期的风险收益水平。本基金产品投资策略包括：资产配置策略、ETF投资策略、非上市基金投资策略、股票投资策略、固定收益资产投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略等策略。
业绩比较基准	95%*标普500指数收益率（使用估值汇率折算）+5%*人民币活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金主要投资于境外跟踪标普500指数的相关基金（包括ETF），力争实现对标普500指数走势的有效跟踪。本基金长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金可投资于境外证券，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，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

注：详见《天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）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



注：本基金未持有各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证。

(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: 天弘标普500发起 (QDII-FOF) D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天≤N<30天	1.00%	
	30天≤N	0.00%	

注: 天弘标普500发起 (QDII-FOF) 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	0.60%	基金管理人和销售机构
托管费	0.25%	基金托管人
销售服务费	0.25%	销售机构
审计费用	60,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	100,000.00 元	规定披露报刊
指数许可使用费	0.06%	指数编制公司
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)
1.25%

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。

本基金特有的风险：

1、投资标的的特有风险：本基金主要投资于境外跟踪标普500指数的相关基金（包括ETF），力争实现对标普500指数走势的有效跟踪。标普500指数创建于1957年，是美国第一个市值加权股票市场指数，包含了500家在美国经济体里举足轻重的上市公司，大约覆盖可投资市值的80%。标普500指数一直以来被认为是代表美股大盘的最好指标，指数旨在反映美国市场大盘股票平均收益的同时也承担相应的市场风险。由于本基金主要投资于指数化投资工具（包括ETF）以及主动管理基金和公司股票，因此，本基金将面临被动型和主动型投资工具的特有风险。指数化投资工具的投资风险：

1) 境外跟踪标普500指数的相关基金（包括ETF）主要投资于标普500指数的成份股，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。

2) 由于境外跟踪标普500指数的ETF的价格受到二级市场需求和供给的影响，境外跟踪标普500指数的ETF的市场价格可能与该基金资产净值不同。因此，如果投资人选择通过二级市场变现，可能随之产生价格风险。

3) 境外跟踪标普500指数的ETF投资标的有可能因缺乏流动性而对基金产生损失。

主动管理基金及标普500指数成份股等公司股票除受股票市场波动的影响外，还存在下列风险：

1) 主动管理基金管理团队的管理能力、管理经验不足，投资风格多变。

2) 标普500指数成份股等公司股票受公司基本面、市场流动性等因素的不利影响。

2、基金经理对基金的主动性操作导致的风险。本基金是一只主动管理型基金，主要精选全球范围内跟踪标普500指数的公募基金（包含ETF）及公司股票。在本基金精选基金以及个股的操作过程中，基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选的基金或个股的业绩表现并不一定持续的优于其他的基金或者股票。

3、本基金为发起式基金，基金合同生效三年后的对应日，若基金规模低于2亿元的，基金合同将自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。同时，若本基金连续六十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。因此，基金份额持有人还有可能面临基金合同自动终止的风险。

其他风险：海外投资的特殊风险，包括海外市场风险、汇率风险、政治风险等；开放式基金风险，包括流动性风险、管理风险、大额赎回风险、衍生品投资风险等。

（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]

- 《天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）基金合同》
- 《天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）托管协议》
- 《天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）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