

天弘中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(C类份额)基金产品资料概要(更新)

编制日期: 2024年06月27日

送出日期: 2024年06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	天弘中证芯片产业ETF发起联接	基金代码	012552
基金简称C	天弘中证芯片产业ETF发起联接C	基金代码C	012553
基金管理人	天弘基金管理有限公司	基金托管人	光大证券股份有限公司
基金合同生效日	2021年07月21日		
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	林心龙	开始担任本基金基金经理的日期	2024年05月06日
		证券从业日期	2015年07月06日
其他	1、天弘中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由天弘中证芯片产业指数型发起式证券投资基金转型而来。 2、《天弘中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金合同》生效满三年之日(指自然日),若基金资产净值低于2亿元的,本基金应当按照基金合同的约定程序进行清算并终止,无需召开基金份额持有人大会审议,并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。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,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。《天弘中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金合同》生效后继续存续的,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

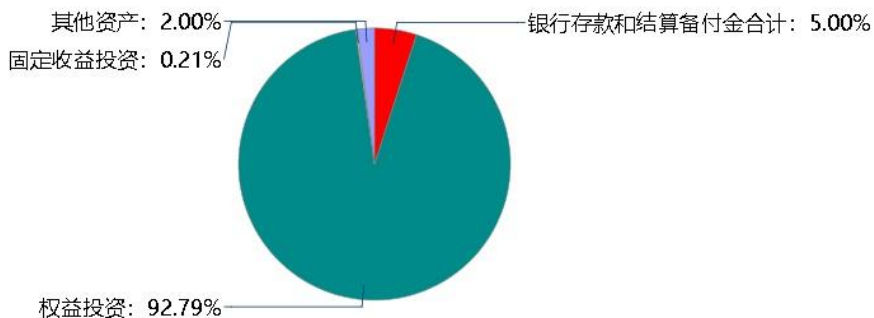
投资目标	通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金的标的指数为中证芯片产业指数。 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以目标ETF基金份额、标

	<p>的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、银行存款、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）、债券回购、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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>本基金为目标ETF的联接基金，目标ETF是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。主要投资策略包括：目标ETF投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、股指期货投资策略。</p>
业绩比较基准	<p>中证芯片产业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金为ETF联接基金，且目标ETF为股票型指数基金，因此本基金的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。本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>

注：详见《天弘中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》“基金的投资”章节。

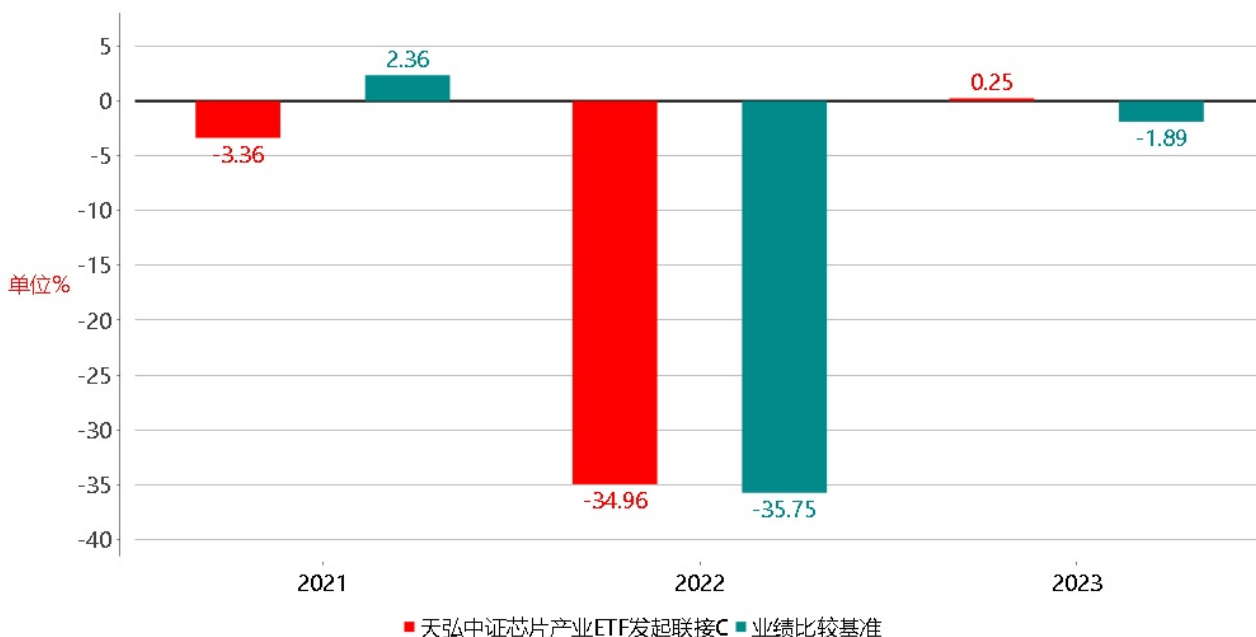
（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

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	-	-	
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N	0.00%	

注：天弘中证芯片产业ETF发起联接C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	0.25%	销售机构
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、本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费和托管费。
2、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。
3、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）
0.87%

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。

本基金特有风险：1、投资于目标ETF基金带来的风险：由于主要投资于目标ETF，在多数情况下将维持较高的目标ETF投资比例，基金净值可能会随目标ETF的净值波动而波动，目标ETF的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。所以本基金会面临诸如目标ETF的管理风险与操作风险、目标ETF基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标ETF的技术风险等风险。2、跟踪偏离风险：本基金主要投资于目标ETF基金份额，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。以下因素可能会影响到基金的投资组合与跟踪基准之间产生偏离：（1）目标ETF与标的指数的偏离。（2）基金买卖目标ETF时所产生的价格差异、交易成本和交易冲击。（3）基金调整资产配置结构时所产生的跟踪误差。（4）基金申购、赎回因素所产生的跟踪误差。（5）基金现金资产拖累所产生的跟踪误差。（6）基金的管理费和托管费所产生的跟踪误差。（7）其他因素所产生的偏差。3、与目标ETF业绩差异的风险：本基金为目标ETF的联接基金，但由于投资方法、交易方式等方面与目标ETF不同，本基金的业绩表现与目标ETF的业绩表现可

能出现差异。4、其他投资于目标ETF的风险：如目标ETF参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、目标ETF退市风险、申购赎回失败风险等等。5、本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以目标ETF基金份额、标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。如指数成份股发生明显负面事件面临退市或违约风险时，可能在一定时间后被剔除指数成份股，或由于尚未达到指数剔除标准，仍存在于指数成份股中。为充分维护基金份额持有人的利益，针对前述风险证券，基金管理人有权降低配置比例或全部卖出，或进行合理估值调整，从而可能造成与标的之间的跟踪偏离度和跟踪误差扩大。6、跟踪误差控制未达约定目标的风险：本基金力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率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。7、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）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款项，由此基金管理人可能根据基金合同的约定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明显负面事件面临退市风险，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。9、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内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，基金合同另有约定的除外。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。10、本基金为发起式基金，《天弘中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金合同》生效满三年之日（指自然日），若基金资产净值低于2亿元的，本基金应当按照基金合同的约定程序进行清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，并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，《天弘中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金合同》生效三年后继续存续的，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。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。11、基金投资特定品种可能引起的风险：（1）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）资产支持证券投资风险：本基金的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券存在一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。（3）股指期货投资风险：本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股指期货所面临的主要风险是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险。具体为：1）市场风险是指由于股指期货价格变动而给投资人带来的风险。市场风险是股指期货投资中最主要的风险；2）流动性风险是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险；3）基差风险是指股指期货合约价格和标的指数价格之间价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的

波动所造成的期限价差风险；4) 保证金风险是指由于无法及时筹措资金满足建立或维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险；5) 信用风险是指期货经纪公司违约而产生损失的风险；6) 操作风险是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。（4）基金参与融资与转融通证券出借业务的风险：本基金可参与融资及转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：1) 流动性风险：面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险；2) 信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券，无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；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；当已出借证券或一篮子证券中，有部分或单一权重较大的证券，股价出现连续的下跌或连续的上涨，可能造成按市值加权平均计算的出借剩余期限，较大偏离出借之日所预计的平均期限；同时，股价出现连续的下跌或连续的上涨，也会使出借证券的资产占基金资产净值的权重，在出借期间偏离出借之日所预计的权重；4) 政策风险：证券出借后如遇相关法律法规要求发生变化，可能影响业务后继运作和收益，甚至产生损失。

其他风险：市场风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规性风险、税负增加风险、启用侧袋机制的风险、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]

- 《天弘中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》
- 《天弘中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》
- 《天弘中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》
- 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