

# 天弘国证新能源电池指数型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要

编制日期：2024年09月23日

送出日期：2024年09月24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	天弘国证新能源电池指数发起	基金代码	021963
基金简称A	天弘国证新能源电池指数发起A	基金代码A	021963
基金管理人	天弘基金管理有限公司	基金托管人	广发证券股份有限公司
基金合同生效日	暂无		
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	贺雨轩	开始担任本基金基金经理的日期	暂无
		证券从业日期	2015年06月07日
其他	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。若届时的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。《基金合同》生效满三年后继续存续的，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60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。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，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国证新能源电池指数。 本基金主要投资于标的指数的成份股和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可能会少量投资于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核准或注册上市的股票、存托凭证）、

	<p>债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、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。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权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。股指期货、国债期货、股票期权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>
<b>主要投资策略</b>	<p>本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其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化进行相应调整。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。本基金的投资策略包括：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、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。</p>
<b>业绩比较基准</b>	<p>国证新能源电池指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%</p>
<b>风险收益特征</b>	<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，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。</p>

注：详见《天弘国证新能源电池指数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

注：天弘国证新能源电池指数发起A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：天弘国证新能源电池指数发起A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	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
------	---------------	---------	----

认购费	M<500万	0.80%	
	500万≤M	1000元/笔	
申购费	M<500万	1.00%	
	500万≤M	1000元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	0.30%	
	30天≤N	0.05%	

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/年费率或金额	收取方
管理费	0.15%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
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：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。

## 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、本基金是股票型指数基金，原则上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。2、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。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。4、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。5、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。6、跟踪误差控制未达约定目标的风险：在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%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。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，由此基金管理人根据基金合同的约定可能采取延缓支付赎回款项或者暂停赎回的措施，投资者将面临无法按时获得赎回款项或者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、基金管理人有权决定本基金是否转型为基金管理人同时管理的跟踪同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金(ETF)联接基金并相应修改基金合同，如决定以ETF联接基金模式运作，则基金管理人有权在履行适当程序后使本基金转型为该基金的联接基金，并相应修改基金合同，届时无需召开基金份额持有人大会，但需提前公告。投资者还有可能面临基金自动转型的风险。

11、本基金为发起式基金，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。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。

12、基金投资特定品种可能引起的风险：（1）存托凭证投资风险：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。（2）资产支持证券投资风险：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。（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）国债期货的投资风险：本基金可投资国债期货，所面临的风险如下：1）杠杆性风险。国债期货交易采用保证金交易方式，潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。2）到期日风险。国债期货合约到期时，如本基金仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将本基金持有的合约进行现金交割，本基金存在无法继续持有到期合约的可能，具有到期日风险。国债期货合约采取实物交割方式，如本基金未能在规定期限内如数交付可交割国债或者未能在规定期限内如数缴纳交割货款，将构成交割违约，交易所将收取相应的惩罚性违约金。3）强制平仓风险。如本基金参与交割不符合交易所或者期货公司相关业务规定，期货公司有权不接受本基金的交割申请或对本基金的未平仓合约强行平仓，由此产生的费用和结果将由基金承担。4）使用国债期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将期货合约展期时，合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性，面临跨期基差风险。（5）股票期权投资风险：本基金可投资于股票期权，投资股票期权的风险包括但不限于市场风险、流动性风险、交易对手信用风险、操作风险、保证金风险等。由此可能增加本基金净值的波动性。（6）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。（7）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：本基金投资于科创板上市公司不一定盈利，而且还可能面临更大的投资风险。一方面，科创板上市公司企业相对集中于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域，往往具有科技投入大、迭代快、风险高、易被颠覆等特点，存在因重大技术、产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分科创企业可能尚处于初步发展阶段，企业持续创新能力、主营业务发展可持续性、公司收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，个股投资风险加大。此外，科创板企业普遍具有前景不确定、业绩波动大、风险高的特征，市场可比公司较少，估值与发行定价难度较大。因此，本基金在追求科创板企业带来收益的同时，须承受科创板企业带来的风险，本基金投资于科创板企业面临无法盈利甚至可能导致较大亏损的风险。投资者投资于本基金前，须对科创板市场（包括科创板股票的价格影响因素和交易规则等）有一定了解和认知，在理性判断的基础上做出审慎投资选择。2）股价大幅波动风险：科创板竞价交易较主板设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的前5个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为20%）、科创板股票上市首日即可作为融资融券标的，可能导致较大的股票价格波动，从而导致本基金净值出现大幅波动的风险。3）流动性风险：科创板投资门槛较高，由此可能导致整体流动性相对较弱。此外，科创板股票网下发行时，获配账户存在被随机抽中设置一定期限限售期的可能，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。4）红筹企业的投资风险：符合相关规定的红筹企业可以在科创板上市。红筹企业在境外注册，可能采用协议控制架构，在信息披露、分红派息等方面可能与境内上市公司存在差异。红筹公司注册地、境外上市地等地法律法规对当地投资者提供的保护，可能与境内法律为境内投资者提供的保护存在差异。红筹企业可以发行股票或存托凭证在科创

板上市。存托凭证由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行,代表境外基础证券权益。红筹公司存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当,但不能等同于直接持有境外基础证券。投资者应当充分知悉存托协议和相关规则的具体内容,了解并接受本基金在交易和持有红筹公司股票或存托凭证过程中可能存在的风险。

5) 科创板企业退市风险: 科创板退市制度较主板更为严格, 退市时间更短, 退市速度更快, 退市情形更多, 且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节。一旦所投资的科创板股票进入退市流程, 将面临退出难度较大、成本较高的风险。

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: 科创板股票在发行与交易机制上与主板市场存在差异, 可能使本基金标的指数波动较大, 从而导致本基金净值出现大幅波动的风险。科创板股票在发行与交易机制上与主板市场存在差异包括但不限于: ①科创板新股发行价格、规模、节奏等坚持市场化导向, 询价、定价、配售等环节由机构投资者主导。科创板新股发行全部采用询价定价方式, 询价对象限定在证券公司等七类专业机构投资者, 而个人投资者无法直接参与发行定价。同时, 因科创板企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征, 市场可比公司较少, 传统估值方法可能不适用, 发行定价难度较大, 科创板股票上市后可能存在股价波动的风险。②初步询价结束后, 科创板发行人预计发行后总市值不满足其在招股说明书中明确选择的市值与财务指标上市标准的, 将按规定中止发行。③科创板股票网上发行比例、网下向网上回拨比例、申购单位、投资风险特别公告发布等与目前上交所主板股票发行规则存在差异, 投资者应当在充分知悉并关注相关规则。④首次公开发行股票时, 发行人和主承销商可以采用超额配售选择权, 不受首次公开发行股票数量条件的限制, 即存在超额配售选择权实施结束后, 发行人增发股票的可能性。⑤科创板制度允许上市公司设置表决权差异安排。上市公司可能根据此项安排, 存在控制权相对集中, 以及因每一特别表决权股份拥有的表决权数量大于每一普通股份拥有的表决权数量等情形, 而使普通投资者的表决权及对公司日常经营等事务的影响力受到限制。⑥出现《上海证券交易所科创板股票上市规则》以及上市公司章程规定的情形时, 特别表决权股份将按1:1的比例转换为普通股份。股份转换自相关情形发生时即生效, 并可能与相关股份转换登记时点存在差异。⑦相对于主板上市公司, 科创板上市公司的股权激励制度更为灵活, 包括股权激励计划所涉及的股票比例上限和对象有所扩大、价格条款更为灵活、实施方式更为便利。实施该等股权激励制度安排可能导致公司实际上市交易的股票数量超过首次公开发行时的数量。⑧科创板股票在涨跌幅限制, 做市商机制, 交易的单笔申报数量、最小价格变动单位、有效申报价格范围, 盘中临时停牌情形和严重异常波动股票核查制度等与上交所主板市场股票交易存在差异。

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: 若监管部门推出科创板长期投资者相关制度, 在符合基金合同约定及长期投资者要求的前提下, 本基金可申请作为科创板长期投资者参与投资, 并需遵循长期投资者相关要求及限制, 届时科创板企业的经营情况及风险可能给本基金带来更大影响。

9) 科创板设立和注册制试点时间较短的风险: 科创板的设立和注册制的试点时间较短, 其效果仍待市场检验, 且后续可能根据国情、市场情况、投资者情况等对相关规则作出必要的调整和完善。投资者投资于本基金将可能面临因为试点效果不及预期、规则的调整变化等原因导致基金净值下跌或大幅波动的风险。

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、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]

- 《天弘国证新能源电池指数型发起式证券投资基金基金合同》
- 《天弘国证新能源电池指数型发起式证券投资基金托管协议》
- 《天弘国证新能源电池指数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