

泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 25 日

送出日期：2024 年 6 月 26 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	泰康 300	基金代码	515380
基金管理人	泰康基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2019 年 12 月 27 日	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2020 年 3 月 23 日
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	魏军	开始担任本基金基金经理的日期	2019 年 12 月 27 日
		证券从业日期	2008 年 5 月 15 日
其他	(1) 未来若出现标的指数不符合要求(因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当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。(2)《基金合同》生效后,连续 60 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 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,解决方案包括持续运作、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 个月内召开基金份额持有人大会进行表决。		

注：扩位证券简称：沪深 300ETF 泰康

二、基金投资与净值表现

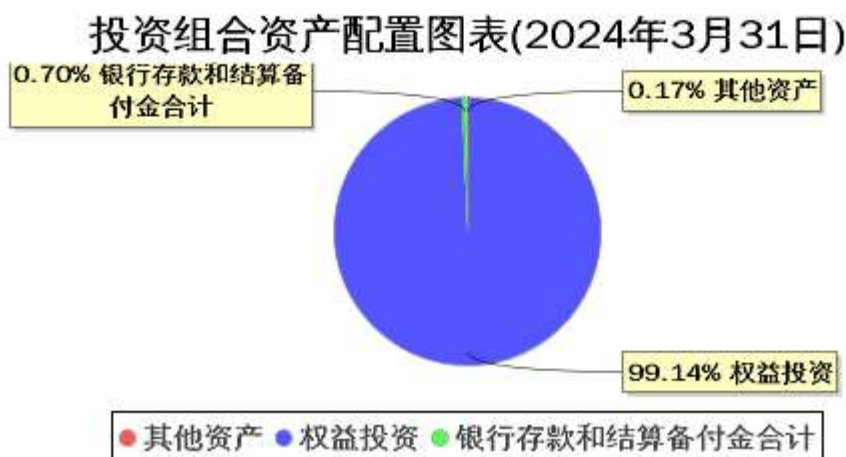
(一) 投资目标与投资策略

(请投资者阅读《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况)

投资目标	紧密跟踪标的指数（沪深 300 指数），追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争实现与标的指数表现一致的长期回报。
投资范围	本基金主要投资于沪深 300 指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，还可投资于部分非成份股、存托凭证、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、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、同业存单、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。本基金可根据法律法规的规定参与融资

	<p>和转融通证券出借业务。</p> <p>本基金的投资组合比例：在建仓完成后，投资于沪深 300 指数成份股和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%。</p>
主要投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照沪深 300 指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据沪深 300 指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但是，如因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他股票或证券组合对沪深 300 指数中的股票加以替换。正常情况下，本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>2、股指期货投资策略</p> <p>本基金在风险可控的前提下，以套期保值为目的参与股指期货投资。</p> <p>3、债券与资产支持证券投资策略</p> <p>本基金债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>对于可转换债券，本基金着重对可转换债券所对应的基础股票进行分析和研究，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注。</p> <p>对于资产支持证券，将估计资产违约风险和提前偿付风险，辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。</p> <p>4、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>对于证券公司短期公司债券，本基金对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，确定投资决策。</p> <p>5、融资及转融通证券出借业务</p> <p>本基金将审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券、期限以及投资比例。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

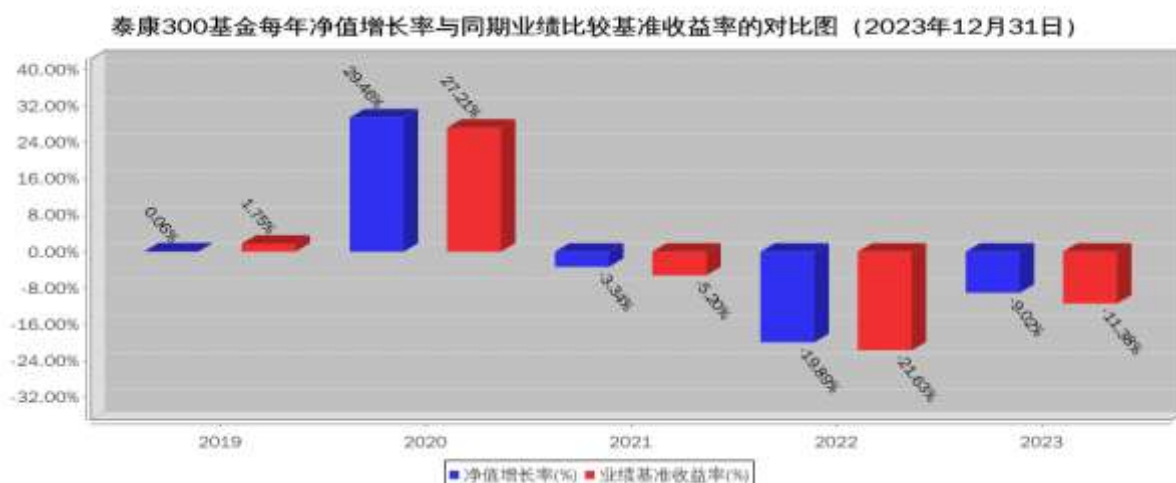


注：（1）本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 83,616,210.00 元，占期末资产净值比例为 2.36%。

（3）股票投资项含可替代款的估值增值。

（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：本基金成立于 2019 年 12 月 27 日，2019 年度相关数据的计算期间为 2019 年 12 月 27 日至 2019 年 12 月 31 日，图示业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.50% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

基金场内交易费用以证券公司实际收取为准。

（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	0.40%		基金管理人和销售机构
托管费	0.05%		基金托管人
审计费用	100,000.00 元		会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元		规定披露报刊
指数许可使用费	0.03%	年下限金额： 35,000.00 元	指数编制公司
其他费用	具体参见《招募说明书》“基金费用与税收”章节		

注：（1）就每个计费季度而言，如果当季度的日均基金资产净值大于人民币 5000 万元时，指数许可使用费收取的下限金额为每完整季度人民币 3.5 万元；计费期间不足一季度的，按照当季基金存续天数占当季天数的比例计算指数许可使用费下限金额。

（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）本基金运作相关费用年金额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

若投资者认购/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）
0.49%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）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。投资者可能损失投资本金。

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。

本基金的主要投资风险包括市场风险、信用风险、流动性风险等。市场风险是指证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险，本基金的市场风险来源于基金股票资产与债券资产市场价格的波动；信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，或证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

本基金作为 ETF 特有的主要风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、IOPV 计算错误的风险、申购赎回清单差错风险、退市风险、退补现金替代方式的风险、申购失败的风险、赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、二级市场流动性风险、第三方机构服务风险等。

本基金可参与转融通证券出借业务，可能面临相关业务对手方的信用风险和由此产生的流动性风险等。

本基金可投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，例如市场风险、股价波动风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险、退市风险和其他风险。

本基金还面临特有的投资风险，包括投资股指期货、投资存托凭证、投资资产支持证券和证券公司短期公司债券等带来的风险。

此外，本基金可能还面临管理风险、合规性风险、操作风险以及其他风险等。

(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

以下资料详见基金管理人网站 www.tkfunds.com.cn，基金管理人的全国统一客户服务电话为 4001895522。

基金合同、托管协议、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

六、其他情况说明

争议解决方式：各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点为北京市，仲裁裁决是终局的，并对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

投资者应认真阅读基金合同等法律文件，及时关注销售机构出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必然一致，销售机构的适当性匹配意见并不表明对基金的风险和收益做出实质性判断或者保证。基金合同中关于基金风险收益特征与基金风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应了解基金的风险收益情况，结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险。