

京管泰富中债京津冀债券综合指数证券投资基金（C 份额）

基金产品资料概要

编制日期：2025 年 5 月 11 日

送出日期：2025 年 5 月 12 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    | 京管泰富中债京津冀综合                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 基金代码           | 007299         |
| 下属基金简称  | 京管泰富中债京津冀综合 C                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 下属基金交易代码       | 022835         |
| 基金管理人   | 北京京管泰富基金管理有限责任公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 基金托管人          | 北京银行股份有限公司     |
| 基金合同生效日 | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 上市交易所及上市日期     | —              |
| 基金类型    | 债券型                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 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    | 肖强                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 开始担任本基金基金经理的日期 | —              |
|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 证券从业日期         | 1993 年 2 月 1 日 |
| 其他      | <p>《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 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进行表决。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p> <p>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，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，本基金合同终止。</p> |                |                |

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

|      |                                                                                                                                            |
|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金通过指数化投资，紧密跟踪标的指数，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，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：中债-京津冀债券综合指数。<br>本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（含国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、企业债、公司债、短期融资 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>券、超短期融资券、中期票据、次级债）、资产支持证券、债券回购、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。</p> <p>本基金不投资于股票等权益资产，也不投资可转换债券、可交换债券。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券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。</p> <p>如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行相应程序后，以变更后的规定为准。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金为指数基金，在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则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。</p> <p>具体投资策略包括：1、债券指数化投资策略；2、其他债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、同业存单投资策略；5、现金管理策略。</p>                                                                                                                                                                                                                     |
| 业绩比较基准 | 中债-京津冀债券综合全价（总值）指数收益率 $\times 95\%$ +银行人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型指数基金，长期来看，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

注：了解详细情况请阅读基金合同及招募说明书“基金的投资”部分。

### 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（S）或金额（M）<br>/持有期限（N） | 收费方式/费率 |
|------|-------------------------|---------|
| 赎回费  | $N < 7$ 天               | 1.5%    |
|      | $N \geq 7$              | 0       |

注：投资者选择认购/申购 C 类基金份额的，不收取认购费/申购费，从本类别基金资产中计提销售服务费。

#### （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   | 0.3%                                                                      | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费   | 0.1%                                                                      | 基金托管人      |
| 销售服务费 | 0.1%                                                                      | 销售机构       |
| 其他费用  | 基金合同生效后，按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。 |            |

注：本基金交易证券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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，债券发行人或交易对手违约带来的信用风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的管理风险，本基金的特有风险等。请投资者认真阅读本基金《招募说明书》“风险揭示”章节，详细了解本基金的具体风险。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，暂停披露侧袋账户份额净值，不办理侧袋账户的申购赎回。侧袋账户对应特定资产的变现时间和最终变现价格都具有不确定性，并且有可能变现价格大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能面临损失。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金的特有风险包括但不限于：

1、本基金为债券型基金，债券的投资比例不低于基金资产的 80%，债券投资风险即成为本基金及投资者主要面对的特有投资风险。在具体投资管理中，本基金可能因投资债券类资产而面临较高的市场系统性风险，也可能因投资信用债券而面临较高的信用风险。

#### 2、指数化投资风险

本基金投资于中债-京津冀债券综合指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%，由此可能面临如下特有风险：

##### （1）标的指数下跌风险

基金业绩表现与标的指数存在较大相关性，标的指数的波动将使基金收益水平发生变化，产生风险。尤其是在债券市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

##### （2）信用风险

标的指数成份券包含公司债、金融债、中期票据、企业债等多种品种的信用债券，在指数化投资过程中，本基金可能维持较高的信用债仓位，从而面临显著的信用风险。本基金管理人将严格控制较低评级信用证券的投资比例，加强信用研究和跟踪，强化信用风险防控。

##### （3）区域风险

标的指数成份券发行人所在地集中在北京市、天津市和河北省，区域内的经济形势、财政实力、资源禀赋、政策和市场环境等因素都将对区域内的债券发行人的经营状况产生系统性的影响，同时区域内发行人的风险存在关联性，容易出现传播和扩散。提醒投资者注意本基金投资标的区域集中度较高的风险。

#### 3、标的指数风险

##### （1）标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个债券市场。标的指数成份券的平均回报率与整个债券市场的平均回报率可能存在偏离。

##### （2）标的指数波动的风险

标的指数成份券的价格可能受到政治因素、经济因素、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。

##### （3）标的指数计算出错的风险

指数编制方法的缺陷可能导致标的指数的表现与总体市场表现产生差异，从而使基金收益发生变化。同时，中债金融估值中心有限公司不对指数的实时性、完整性和准确性做出任何承诺。标的指数值可能出

现错误，投资者若参考指数值进行投资决策可能导致损失。

以下为本基金标的指数的编制商发布的免责声明：

“指数由中债金融估值中心有限公司编制和计算。关于指数值和样本券名单的所有知识产权和其他权益归属中债金融估值中心有限公司（或其任何许可方）。中债金融估值中心有限公司未针对指数相关信息的准确性、完整性或及时性或数据接收者可能得到的结果作出任何明示或默示的保证。”

对于中债金融估值中心有限公司上述免责声明中提及的可能对基金、投资者及相关服务机构造成的损失，基金管理人亦不承担任何责任。

#### （4）标的指数编制方案带来的风险

本基金标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，指数编制机构有权停止编制标的指数、变更标的指数编制方案。而指数编制方案基于其样本空间仅能选取部分证券予以构建，其表征性与可投资性可能存在不成熟或不完备之处。

当指数编制机构变更标的指数编制方案，导致指数成份券样本与权重发生调整，基金管理人需调整投资组合，从而可能增加基金运作难度、跟踪误差和组合调整的风险与成本，并可能导致基金风险收益特征发生较大变化；此外，当市场环境发生变化，但指数编制机构未能及时对指数编制方案进行调整时，可能导致标的指数的表现与总体市场表现存在差异，从而影响投资收益。投资人需关注并承担上述风险，谨慎作出投资决策。

#### （5）标的指数变更的风险

根据基金合同的约定，若标的指数更名，经与基金托管人协商一致，基金管理人应调整基金名称、修改基金合同并公告，但无需召开基金份额持有人大会。若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，由基金管理人根据标的指数变更情形履行对应适当程序，并在调整实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

届时基金合同将发生变更，基金的风险收益特征将与新的标的指数一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### （6）指数编制机构停止服务的风险

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，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。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。

### 4、基金跟踪偏离风险

在正常市场环境下，本基金力争将年化跟踪误差控制在 4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35%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。

本基金在跟踪标的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可能产生差异，主要影响因素可能包括：

（1）本基金采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，基金投资组合与标的指数构成可能存在差异，从而可能导致基金实际收益率与标的指数收益率产生偏离；

（2）指数调整成份券时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本；

（3）基金运作过程中发生的费用，包括交易成本、市场冲击成本、管理费和托管费等，可能导致本基金在跟踪指数时产生收益上的偏离；

（4）基金发生申购或赎回时将带来一定的现金流或变现需求，当债券市场流动性不足时，或受银行间债券市场债券交易起点的限制，本基金投资组合面临一定程度的跟踪偏离风险；

（5）在指数化投资过程中，基金管理人对于指数基金的管理能力例如跟踪指数的技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对业绩比较基准的跟踪程度。

#### 5、成份券停牌或违约风险

（1）标的指数成份券可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份券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，标的指数成份券可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份券以获取足额的符合要求的赎回价格，由此基金管理人可能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。

（2）标的指数成份券可能发生明显负面事件或违约风险，此时本基金面临如下风险：

①若指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后对相关成份券进行调整，从而可能导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；

②若指数编制机构已作出调整的，但由于市场流动性等原因，基金管理人可能无法及时跟随指数调整方案处置发生明显负面事件或违约的证券，从而导致基金财产损失，以及跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

#### 6、本基金的投资范围包含资产支持证券，可能带来以下风险：

（1）信用风险：基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

（2）利率风险：市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言如果市场利率上升，本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

（3）流动性风险：受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。

（4）提前偿付风险：债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使基金资产面临再投资风险。

#### 7、债券回购风险

债券回购为提升基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。例如：回购交易中，交易对手在回购到期时不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金财产损失的风险；回购利率大于债券投资收益而导致的风险；由于回购操作导致投资总量放大，进而放大基金组合风险的风险；债券回购在对基金组合收益进行放大的同时，也放大了基金组合的波动性（标准差），基金组合的风险将会加大；回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。如发生债券回购交收违约，质押券可能面临被处置的风险，因处置价格、数量、时间等的不确定，可能会给基金资产造成损失。

#### 8、基金变更风险

若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人经与托管人协商一致后可按照法律法规规定和基金合同约定在履行适当程序后使本基金调整为该交易型开放式指数基金（ETF）的联接基金模式运作并相应修改《基金合同》。投资者还有可能面临《基金合同》相应修改的风险。

## （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。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。

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.cdbsfund.com](http://www.cdbsfund.com)），投资人也可拨打客服电话（400-898-3299）了解更多详细信息。

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料

## 六、其他情况说明

无。