

泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金（泰康北交所精选两年定开混合发起C份额）

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	泰康北交所精选两年定开混合发起	基金代码	016325
下属基金简称	泰康北交所精选两年定开混合发起C	下属基金交易代码	016326
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	2023年4月7日	上市交易所及上市日期	-
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式	开放频率	每两年开放一次，开放期为5-20个工作日
基金经理	陆建巍	开始担任本基金基金经理的日期	2023年4月7日
		证券从业日期	2009年7月10日
其他	基金合同生效之日起3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，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》生效满3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，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个月内召集基金份额持有人大会进行表决。		

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)

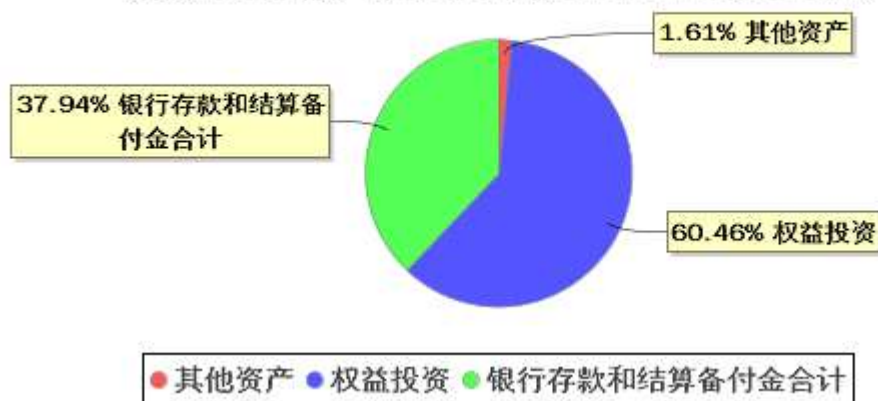
投资目标	本基金在严格控制风险的原则下，通过合理配置大类资产和精选北交所上市股票，追求基金资产的长期增值。
投资范围	本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含北京证券交易所及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券

	<p>资产（包括国债、央行票据、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、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款和其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、国债期货、信用衍生品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。</p> <p>其中，股票投资部分可采取战略配售方式进行投资，除战略配售方式以外，本基金也可以通过中国证监会允许的其他方式进行股票投资。</p> <p>本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。在封闭期内，本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。</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>本基金投资组合比例为：封闭期内，本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 60%—100%，其中投资于北交所股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 20%；每个封闭期结束前的两个月至开放期结束后两个月内不受上述比例限制。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%；封闭期内不受前述 5% 限制，但封闭期内每个交易日日终，在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>通过基金管理人构建的权益投资决策分析体系（MVPCT 系统）定期评估宏观经济和投资环境，根据股票、债券、货币市场工具预期收益和风险，确定三者的最优配置比例并适时调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金投资于北交所上市股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。充分考虑不同行业企业驱动力的不同，合理分配不同行业股票的资产占比。</p> <p>在定量分析方面，本基金将从成长性、价值性以及估值水平三个方面进行考量。本基金也将关注各个市场优质中小企业的投资机会，优选具备投资价值的个股纳入投资组合。</p> <p>本基金可投资存托凭证，通过定性分析和定量分析相结合的方式，选择投资价值高的存托凭证进行投资。</p> <p>3、基金参与港股通交易，基金资产并非必然投资港股。</p> <p>4、战略配售策略</p> <p>封闭期到期前，控制战略配售方式参与股票投资，本基金的剩余封闭期应长于获配股票的剩余锁定期。</p> <p>5、融资及封闭期内的转融通证券出借业务投资策略</p> <p>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> <p>6、债券投资策略</p> <p>（1）债券投资策略</p> <p>债券投资策略包括久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略、信用策略、个券精选策略等。其中：</p> <p>证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，并适当控制债券投资组合整体的久期，</p>

	<p>防范流动性风险。</p> <p>(2) 可转换债券和可交换债券投资策略 本基金将采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入。</p> <p>(3) 资产支持证券投资策略 通过评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，精选品种进行投资。</p> <p>7、衍生品投资策略 本基金可投资股指期货、国债期货。若本基金投资股指期货、国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。 本基金投资信用衍生品，将按照风险管理的原则，以风险对冲为目的。</p> <p>8、开放期投资策略 本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证 1000 指数收益率*70%+恒生指数收益率*5%+中债新综合全价（总值）指数收益率*25%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p>

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

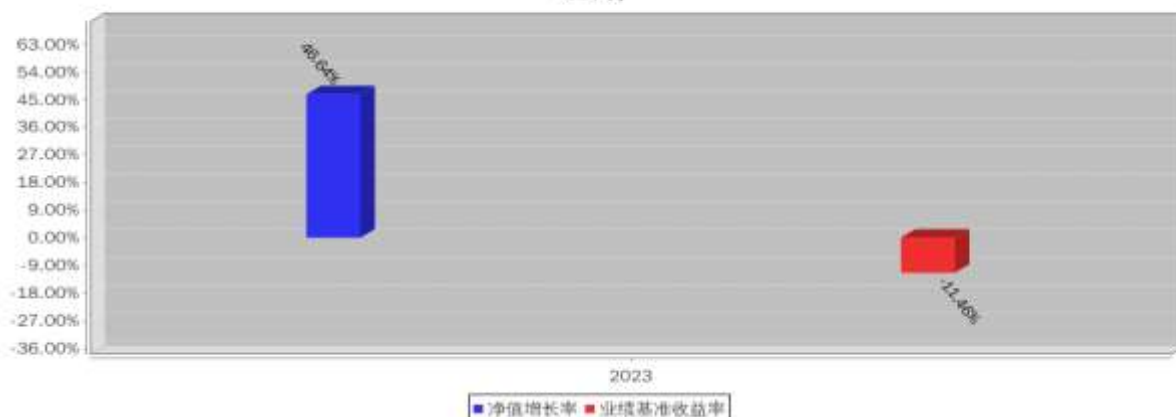
投资组合资产配置图表(2024年3月31日)



注：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。

(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

泰康北交所精选两年定开混合发起C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2023年12月31日）



注：本基金成立于 2023 年 4 月 7 日，2023 年度相关数据的计算期间为 2023 年 4 月 7 日至 2023 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

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) /持有期限 (N)	收费方式/费率
赎回费	N < 50 日	1.50%
	N ≥ 50 日	0.00%

注：本基金 C 份额不收取申购费。

（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	1.20%	基金管理人和销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
销售服务费	0.50%	销售机构
审计费用	36,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	50,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	具体参见《招募说明书》“基金费用与税收”章节	

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）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：

泰康北交所精选两年定开混合发起 C

基金运作综合费率（年化）
1.98%

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。市场风险即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。信用风险即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，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。流动性风险即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。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人启用侧袋机制后，基金份额持有人可能面临侧袋账户份额不可赎回、特定资产变现时间和变现价格不确定的风险。

本基金资产投资于北京证券交易所发行上市的股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于流动性风险、转板风险、投资集中风险、经营风险、退市风险、股价波动风险、投资战略配售股票风险等。

本基金根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，存在不投资港股的可能性；如选择投资港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金还可能面临投资股指期货、国债期货、信用衍生品、参与股票申购、证券公司短期公司债券、资产支持证券、流通受限证券、存托凭证所带来的风险。

本基金以定期开放方式运作，每两年开放一次申购和赎回，投资者只能在开放期提出申购、赎回申请，面临在封闭期内无法申购或赎回的风险。由于本基金在开放期集中开放赎回，故开放期出现巨额赎回的可能性较大，带来更高的流动性风险。在开放期该单一投资者申购时导致基金规模突然增大的可能性较大，当申购资金不能及时或有效投资时，可能导致基金净值突然下跌的风险。

基金合同生效之日起 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，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。投资人将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

本基金可投资于科创板股票，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。

（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深圳国际仲裁院，根据深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点为深圳市，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可能存在差异。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。