

# 泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（泰康中证 500ETF 联接 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。

作出投资决策前，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    | 泰康中证 500ETF 联接   | 基金代码           | 011964          |
| 下属基金简称  | 泰康中证 500ETF 联接 C   | 下属基金交易代码       | 011965          |
| 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 | 2022 年 8 月 1 日   | 上市交易所及上市日期     | -               |
| 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    | 魏军   | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022 年 8 月 1 日  |
|         |  | 证券从业日期         | 2008 年 5 月 15 日 |
| 其他      | 未来若出现标的指数不符合要求（因成份股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。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。《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。 |                |                 |

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

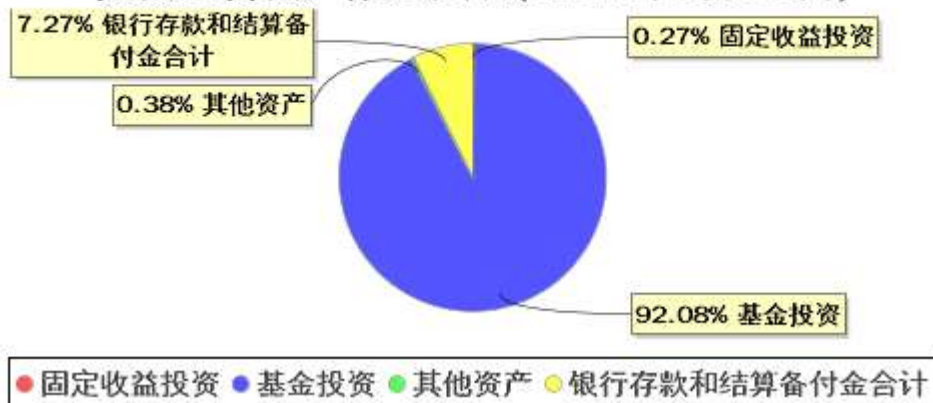
（请投资者阅读《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况）

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过投资于目标 ETF（泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金），紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现                             |

|                      |   |
|----------------------|---|
|                      | <p>投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券资产（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、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、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、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、股指期货、国债期货以及经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>本基金可根据法律法规参与融资和转融通证券出借业务。</p> <p>基金的投资组合比例为：投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。</p>   |
| <p><b>主要投资策略</b></p> | <p>本基金主要投资于目标 ETF，方便投资人通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。在正常市场情况下，本基金力争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不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>1、资产配置策略：根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。</p> <p>2、目标 ETF 投资策略：在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。</p> <p>3、成份股、备选成份股投资策略：主要采取完全复制法，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时，将考虑使用其他合理方法进行部分或全部替代。</p> <p>4、债券投资策略：基于基金流动性管理和有效利用资产的需要，本基金将投资于流动性较好的债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。</p> <p>5、证券公司短期公司债券投资策略：综合考虑和分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力等要素，确定投资决策。</p> <p>6、资产支持证券投资策略：通过信用分析和流动性管理，辅以量化模型投资。</p> <p>7、融资及转融通证券出借业务投资策略：本基金在参与融资业务时，将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金申购赎回情况等因素的研究和判断，决定融资规模。本基金参与转融通证券出借业务，将合理确定出借证券的范围、期限和比例，按照分散化投资原则，分批、分期进行转融通证券出借交易，以分散风险。</p> <p>8、其他金融工具投资策略：基于谨慎原则运用股指期货、国债期货等金融工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。</p> |
| <p><b>业绩比较基准</b></p> | <p>中证 500 指数收益率*95% + 金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%</p>  |
| <p><b>风险收益特征</b></p> | <p>本基金属于 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型基金，其长期平均风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资于目标 ETF 跟踪标的指数，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>  |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

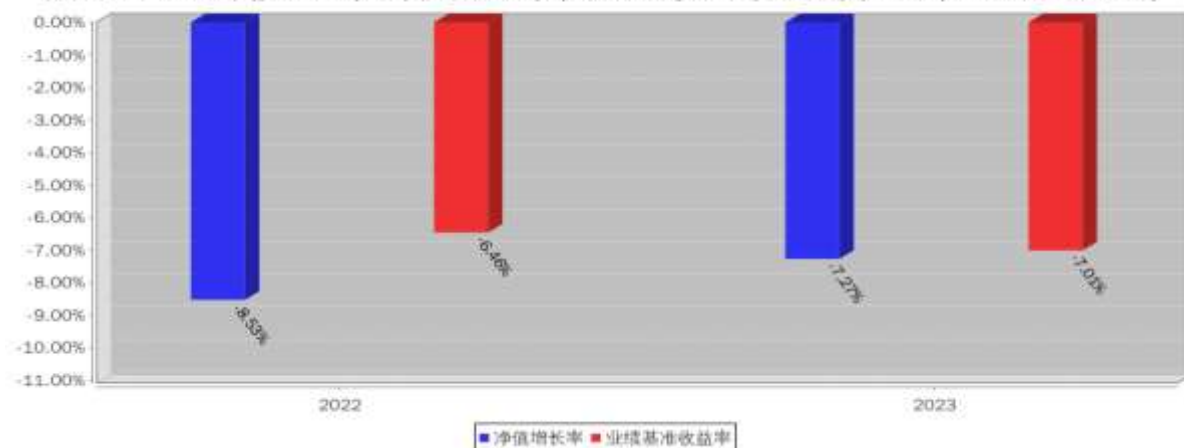
### 投资组合资产配置图表(2024年3月31日)



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

泰康中证500ETF联接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 2022 年 8 月 1 日，2022 年度相关数据的计算期间为 2022 年 8 月 1 日至 2022 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 < 7 日                   | 1.50%   |
|      | N ≥ 7 日                   | 0.00%   |

注：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   | 0.15%                  | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费   | 0.05%                  | 基金托管人      |
| 销售服务费 | 0.40%                  | 销售机构       |
| 审计费用  | 30,000.00 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）本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费、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）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。

（4）本基金自 2024 年 04 月 10 日至 2025 年 04 月 09 日，销售服务费率享受 1 折优惠，即由合同费率 0.40% 调整为 0.04%。

### （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：

泰康中证 500ETF 联接 C

|              |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 0.42%        |

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，其中，当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人启动侧袋机制后，基金份额持有人可能面临侧袋账户份额不可赎回、变现时间和变现价格不确定的风险。

本基金可能遇到的特有风险包括：（1）本基金特有的风险，主要包括：1）ETF 联接基金的特有风险，包括本基金与目标 ETF 基金的业绩表现可能出现差异的风险；2）标的指数波动的风险，即标的指数并不能完全代表整个股票市场，其成分股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离；3）成分股停牌的风险；4）跟踪偏离风险，包括目标 ETF 与标的指数的偏离、本基金买卖目标 ETF 时产生的价格差异/交易成本和交易冲击、标的指数成份股的配股/增发/分红等公司行为、标的指数成份股的调整、本基金买卖股票时产生的交易成本和交易冲击、申购/赎回因素带来的跟踪误差、新股市值配售/新股认购带来的跟踪误差、基金现金资产的拖累、基金的管理费/托管费和销售服务费等带来的跟踪误差、指数成份股停牌/摘牌与

成份股涨/跌停板等因素带来的偏差、基金管理人的买入卖出时机选择、其他因素产生的偏差；5）跟踪误差控制未达约定目标的风险；6）标的指数变更的风险；7）指数编制机构停止服务的风险等。

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。本基金还面临其他特有的投资风险，包括投资股指期货的风险、投资国债期货的风险、投资资产支持证券的风险、投资流通受限证券的风险、投资存托凭证的风险、参与转融通证券出借业务风险等。

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](http://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，根据该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、律师费用由败诉方承担。

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。