

泰康中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要

编制日期：2025 年 9 月 8 日

送出日期：2025 年 9 月 9 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	泰康中证 AAA 科技创新公司债 ETF	基金代码	551580
基金管理人	泰康基金管理有限公司	基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金合同生效日	-	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 -
基金类型	债券型	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	张晓霞	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2012 年 7 月 10 日
其他	(1) 场内简称：科创债 TK；扩位证券简称：科创债 ETF 泰康；认购代码：551583 (2) 《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。 (3) 未来若出现标的指数不符合法律法规及监管要求（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。		

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	通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金标的指数为中证 AAA 科技创新公司债指数。 本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券。为更好地实现投资目标，本基金还

	可以投资于国内依法发行上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、超短期融资券、短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券、可分离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资标的指数成份券和备选成份券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%；本基金每个交易日日终在扣除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，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
主要投资策略	本基金主要采取债券指数化投资策略，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。在正常市场情况下，本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。 1、抽样复制策略 本基金为指数基金，将采用抽样复制法对标的指数进行跟踪。通过对标的指数成份券的历史数据进行分析，选取流动性较好的证券构造与标的指数久期、剩余期限、信用评级、到期收益率等指标相近的投资组合，达到跟踪标的指数、降低交易成本的目的。 2、替代策略 当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券及备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他债券等方式进行替代。 3、非成份债券投资策略 结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。 4、国债期货交易策略、信用衍生品投资策略、资产支持证券投资策略
业绩比较基准	中证 AAA 科技创新公司债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险收益水平理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采取债券指数化投资策略，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	备注
认购费	$S < 500,000$	0.30%	-
	$500,000 \leq S < 1,000,000$	0.15%	-
	$S \geq 1,000,000$	按笔收取，500 元/笔	-

注：通过基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。通过发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构，按照不超过 0.30% 的标准收取一定的佣金。

投资人在申购或赎回时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.2% 的标准向投资人收取佣金，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	0.15%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
其他费用	具体参见《招募说明书》“基金费用与税收”章节	

注：（1）本基金的标的指数许可使用费由基金管理人承担；

（2）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。

（3）本基金基金合同生效当年的信息披露费由基金管理人承担。

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。

本基金可能遇到的主要风险包括：本基金特有风险、市场风险、管理风险、流动性风险、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险、税收风险及其他风险等。

本基金特有风险包括：（1）主要投资于债券市场的风险，将面临市场利率水平变化导致债券价格变化的风险，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下降导致债券价格下降的风险。

（2）指数化投资的风险，包括标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、标的指数编制方案带来的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数值计算出错的风险、指数编制机构停止服务的风险等；（3）ETF 运作的风险，包括参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、组合证券停牌的风险、成份券违约的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、深市成份证券申赎处理规则带来的风险、申购赎回清单相关风险、申购赎回的代理买卖风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、基金分红特殊安排的风险、第三方机构服务的风险、退市风险等；（4）投资特定品种的风险，包括国债期货、资产支持证券、信用衍生品等的特有风险等。具体见本基金《招募说明书》“风险揭示”章节。

投资者投资于本基金前请认真阅读证券交易所和登记结算机构关于 ETF 的相关业务规则及其不时的更新，确保具备相关专业知识和清楚了解相关规则流程后方可参与本基金的认购、申购、赎回及交易。投资者一旦认购、申购或赎回本基金，即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的登记方式以及申购赎回所涉及组合证券、现金替代、现金差额等相关的交收方式及业务规则已经认可。

(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，但不保证投资于本基金一定盈利，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

投资者可在指数编制机构中证指数有限公司的网站(<http://www.csindex.com.cn/>)免费查询标的指数最新的详细信息。

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，任何一方当事人应当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、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。