

泰康沪深 300 指数增强型证券投资基金（泰康沪深 300 指数增强 A 份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2025 年 12 月 4 日

送出日期：2025 年 12 月 5 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	泰康沪深 300 指数增强	基金代码	025676
下属基金简称	泰康沪深 300 指数增强 A	下属基金交易代码	025676
基金管理人	泰康基金管理有限公司	基金托管人	中泰证券股份有限公司
基金合同生效日	2025 年 10 月 28 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	袁帅	开始担任本基金基金经理的日期	2025 年 10 月 28 日
		证券从业日期	2018 年 06 月 29 日
其他	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。		

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	本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求控制本基金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 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%，力争实现超越目标指数的投资收益，谋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，包括沪深 300 指数的成份券及其备选成份券，其他非指数成份券（包括主板、科创板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、股指期货、国债期货、债券资产（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）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、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（但须符合

	中国证监会的相关规定)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资、转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金以标的指数(沪深 300 指数)成份券及其备选成份券为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的 80%,投资于沪深 300 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。 本基金标的指数为中证指数有限公司编制并发布的沪深 300 指数及其未来可能发生的变更。
主要投资策略	1、资产配置策略 本基金为指数增强基金,股票资产投资比例不低于基金资产的 80%,大类资产配置不作为本基金的核心策略。 2、股票投资策略 本基金为股票指数增强型基金,主要利用量化选股模型,在保持对沪深 300 指数紧密跟踪的前提下,力争实现超越目标指数的投资收益。 (1) 指数化被动投资策略 指数化被动投资策略参照标的指数的成份券、备选成份券及其权重,初步构建投资组合,并按照标的指数的调整规则作出相应调整,力求控制本基金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 0.5%,年化跟踪误差不超过 8%。 (2) 指数增强投资策略 量化增强投资策略主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。根据模型结果基金管理人结合市场环境进行组合投资。 股票投资策略还包括存托凭证投资策略等其他策略。 3、债券投资策略 出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量,本基金适时对债券进行投资。 4、资产支持证券投资策略 通过对资产支持证券的发行条款、市场利率、支持资产的构成及质量、支持资产的现金流变动情况以及提前偿还率水平等因素的研究,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,精选那些经风险调整后收益率较高的品种进行投资。 5、其他投资策略 主要包括:参与股指期货交易策略、参与国债期货交易策略、信用衍生品的投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数增强型基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司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
申购费	M<1,000,000	1.20%	非养老金客户

(前收费)	$1,000,000 \leq M < 3,000,000$	0.80%	非养老金客户
	$3,000,000 \leq M < 5,000,000$	0.40%	非养老金客户
	$M \geq 5,000,000$	1,000 元/笔	非养老金客户
	$M < 1,000,000$	0.36%	养老金客户
	$1,000,000 \leq M < 3,000,000$	0.24%	养老金客户
	$3,000,000 \leq M < 5,000,000$	0.12%	养老金客户
	$M \geq 5,000,000$	1,000 元/笔	养老金客户
赎回费	$N < 7$ 日	1.50%	-
	$N \geq 7$ 日	0.00%	-

(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	0.80%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	17,500.00 元	会计师事务所

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、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用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。

本基金的主要投资风险包括市场风险、信用风险、流动性风险：

（1）市场风险：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；（2）信用风险：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；（3）流动性风险：流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

本基金作为指数基金存在的风险包括：（1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险；（2）标的指数变更的风险；（3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险；（4）跟踪误差控制未达约定目标的风险；（5）成份券停牌的风险；（6）指数编制机构停止服务的风险。

本基金还面临特有的投资风险，包括参与股指期货和国债期货交易的风险、参与股票申购的风险、投资于证券公司短期公司债券的风险、投资于资产支持证券的风险、参与转融通证券出借业务的风险、投资于信用衍生品的风险、投资存托凭证的风险等。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。

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。

因此，投资人将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

此外，本基金可能还面临管理风险、合规性风险、操作风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的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按普通程序进行仲裁，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。