

平安中证 500 指数增强发起式证券投资基金(A 类份额)

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2020 年 8 月 24 日

送出日期：2020 年 8 月 25 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	平安中证 500 指数增强	基金主代码	009336
下属基金份额类别	平安中证 500 指数增强 A	下属基金份额类别代码	009336
基金管理人	平安基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2020 年 5 月 27 日		
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	毛时超	开始担任本基金基金经理的日期	2020 年 6 月 1 日
		证券从业日期	2016 年 7 月 5 日
其他	《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金规模低于 2 亿元人民币的，《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		

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的组合管理与严格的风险控制，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。力争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 7.75%。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、现金等，以及法律法规或

	<p>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相关规定)。 本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为:本基金的股票资产占基金资产的比例不低于 80%,投资于标的指数成份股和备选成份股的比例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、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人将在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。 本基金的标的指数为中证 500 指数。</p>
主要投资策略	<p>本基金为增强型指数产品,在参考标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。</p>
业绩比较基准	<p>中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金是一只股票指数增强型基金,其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,本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>

注:详见本基金招募说明书第九部分“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

注:本基金基金合同于 2020 年 5 月 27 日正式生效,截至公告日无定期报告。

(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

注:本基金基金合同于 2020 年 5 月 27 日正式生效,截至公告日无定期报告。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取:

费用类型	金额(M) / 持有期限(N)	收费方式 / 费率
申购费(前收费)	M<100 万	1.20%
	100 万≤M<200 万	0.80%
	200 万≤M<500 万	0.40%
	500 万≤M	每笔 1000 元
赎回费	N<7 日	1.50%
	7 日≤N	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
------	----------

管理费	1.00%
托管费	0.15%
指数许可使用费	0.016%
其他费用	会计费、律师费、审计费等。

注:投资人重复申购,须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

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。

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。

本基金的特定风险:

本基金为增强型指数产品,在参考标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益,存在一定的跟踪偏离风险。此外,在运用量化策略投资的过程中,可能因模型误差等各种原因,其优选出的组合收益率不一定持续高于标的指数的收益率,存在一定的风险。

本基金的其他风险为:

- 1、市场风险;
- 2、管理风险;
- 3、流动性风险;
- 4、股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品投资风险;
- 5、资产支持证券的投资风险;
- 6、流通受限证券的投资风险;
- 7、参与转融通证券出借业务的风险;
- 8、基金财产投资运营过程中的增值税;
- 9、《基金合同》生效之日起三年后的对应日,若基金规模低于 2 亿元人民币的,《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。投资者将可能面临基金合同自动终止的风险;
- 10、 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;
- 11、 其他风险。

(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。

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,如不愿或者不能通过协商、调解解决的,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

以下资料详见平安基金官方网站

网址: www.fund.pingan.com 客服电话: 400-800-4800 (免长途话费)

- 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