

# 平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021年7月12日

送出日期：2021年7月13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    | 平安创业板 ETF 联接   | 基金代码           | 009012      |
| 下属基金简称  | 平安创业板 ETF 联接 A | 下属基金交易代码       | 009012      |
| 下属基金简称  | 平安创业板 ETF 联接 C | 下属基金交易代码       | 009013      |
| 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3月25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    | 成钧             | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020年3月25日  |
|         |                | 证券从业日期         | 2010年9月1日   |
| 基金经理    | 钱晶             | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020年3月25日  |
|         |                | 证券从业日期         | 2011年06月01日 |
| 其他      | 无              |                |             |

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

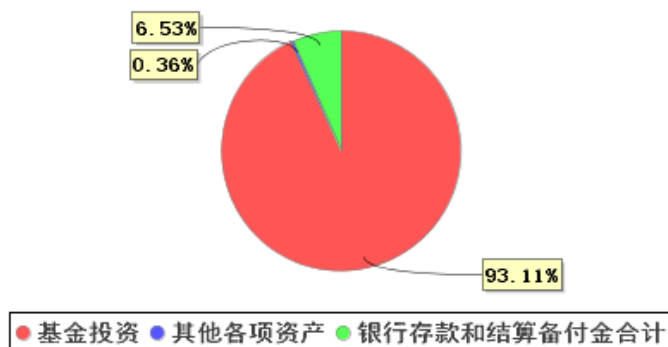
|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 投资范围 | <p>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。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（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、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、信用衍生品、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、国债期货、股指期货、股票期权以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金参与期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。</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</p> |

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|---------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|               | <p>以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金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，持有现金或到期日在一年以内的政府债券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。</p> <p>本基金的标的指数为创业板指数。</p>                                                                                              |
| <b>主要投资策略</b> | <p>本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。主要以一级市场申购的方式投资于目标 ETF，获取基金份额净值上涨带来的收益；在目标 ETF 基金份额二级市场交易流动性较好的情况下，也可以通过二级市场买卖目标 ETF 的基金份额。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绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> |
| <b>业绩比较基准</b> | <p>创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。</p>                                                                                                                                                                                                                                                        |
| <b>风险收益特征</b> | <p>本基金的目标 ETF 为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 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证券市场相似的风险收益特征。</p>                                                                                                                                                              |

注：详见本基金招募说明书“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

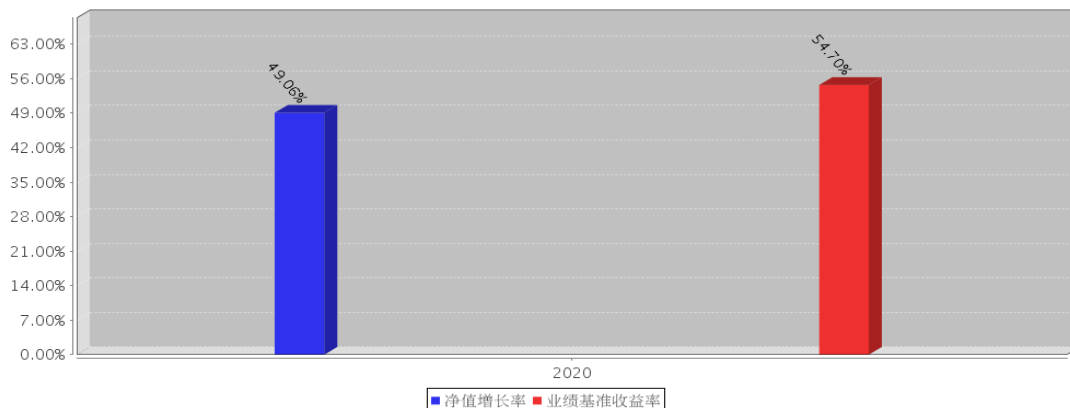
投资组合资产配置图表 (2021年3月31日)



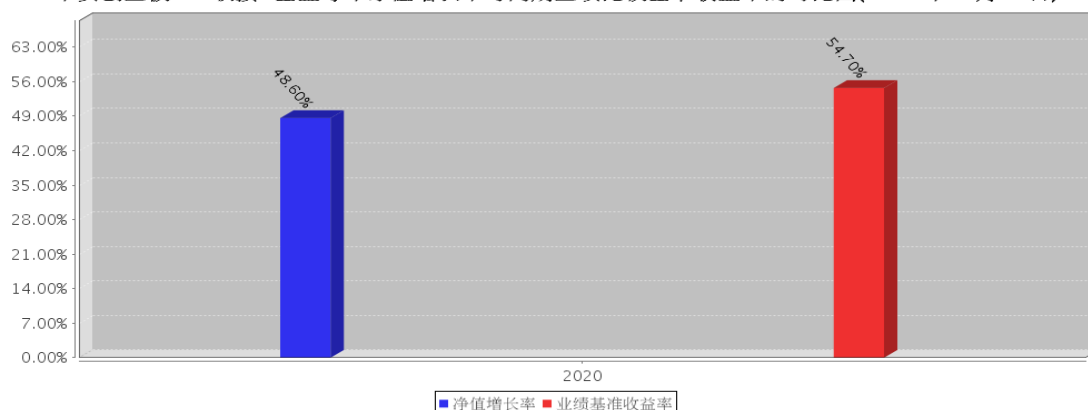
注：由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

(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

平安创业板ETF联接A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(2020年12月31日)



平安创业板ETF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(2020年12月31日)



- 注：1、数据截止日期为 2020 年 12 月 31 日。  
 2、本基金基金合同于 2020 年 3 月 25 日正式生效。  
 3、基金的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

以下费用在申购/赎回基金过程中收取：

平安创业板 ETF 联接 A

| 费用类型         | 份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N) | 收费方式/费率   |
|--------------|---------------------------|-----------|
| 申购费<br>(前收费) | M < 1,000,000             | 0.6%      |
|              | 1,000,000 ≤ M < 2,000,000 | 0.4%      |
|              | 2,000,000 ≤ M < 5,000,000 | 0.2%      |
|              | 5,000,000 ≤ M             | 1,000 元/笔 |
| 赎回费          | N < 7 天                   | 1.5%      |
|              | 7 天 ≤ N < 30 天            | 0.5%      |
|              | N ≥ 30 天                  | 0%        |

平安创业板 ETF 联接 C

| 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 天                   | 1.5%    |
|      | 7 天 ≤ N < 30 天            | 0.5%    |
|      | N ≥ 30 天                  | 0%      |

注：本基金 C 类份额无申购费。

#### (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 |
|------|----------|
| 管理费  | 0.15%    |
| 托管费  | 0.05%    |

|       |                |      |
|-------|----------------|------|
| 销售服务费 | 平安创业板 ETF 联接 C | 0.4% |
| 其他费用  | 会计师费、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。

本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

#### 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。

本基金面临的主要风险有市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特有风险、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及其他风险等。

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时,基金管理人将以保障投资者合法权益为前提,严格按照法律法规及基金合同的规定,谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、摆动定价、暂停估值实施侧袋机制等流动性风险管理工具作为辅助措施。

本基金的特定风险:

1、标的指数的风险:即标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现存在差异,因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大,增加基金投资成本,并有可能因此而增加跟踪误差,影响投资收益。

2、标的指数波动的风险:标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动,导致指数波动,从而使基金收益水平发生变化,产生风险。

3、跟踪偏离风险及跟踪误差控制未达约定目标的风险

跟踪偏离风险:即基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与标的指数表现之间产生差异的不确定性,包括但不限于以下因素:

- (1) 目标 ETF 与标的指数的偏离;
- (2) 基金买卖目标 ETF 时所产生的价格差异、交易成本和交易冲击;
- (3) 标的指数成份股的配股、增发、分红等公司行为;
- (4) 标的指数成份股的调整;
- (5) 基金买卖股票时产生的交易成本和交易冲击;
- (6) 申购、赎回因素带来的跟踪误差;
- (7) 新股市值配售、新股认购带来的跟踪误差;
- (8) 基金现金资产的拖累;
- (9) 基金的管理费、托管费和销售服务等带来的跟踪误差;
- (10) 指数成份股停牌、摘牌,成份股涨、跌停板等因素带来的偏差;
- (11) 基金管理人的买入卖出时机选择;
- (12) 其他因素带来的偏差。

跟踪误差控制未达约定目标的风险: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绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%,但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围,本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

4、标的指数变更的风险

根据基金合同的规定,因标的指数的编制与发布等原因,导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准,本基金可能变更标的指数,或若目标 ETF 变更标的指数,本基金也将相应变更

标的指数且继续投资于该目标 ETF，本基金的投资组合随之调整，基金收益风险特征可能发生变化，投资人需承担投资组合调整所带来的风险与成本。

#### 5、投资于目标 ETF 基金带来的风险

由于主要投资于目标 ETF，所以本基金会面临诸如目标 ETF 的管理风险与操作风险、目标 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标 ETF 的技术风险等风险。

#### 6、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

#### 7、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定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，但基金合同中“目标 ETF 发生相关变更情形时的处理”另有约定的除外。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

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。

#### 8、资产支持证券的投资风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

#### 9、股指期货投资风险

本基金可投资股指期货，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

#### 10、国债期货投资风险

本基金的投资范围包括国债期货，国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。

#### 11、股票期权投资风险

本基金的投资范围包括股票期权，股票期权的风险主要包括市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。基金管理人为了更好的防范投资股票期权所面临的各类风险，建立了股票期权交易决策小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项。

#### 12、信用衍生品投资风险

信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险。流动性风险是信用衍生品在交易转让过程中因为无法找到交易对手或交易对手较少导致难以将其变现的风险。偿付风险是在信用衍生品的存续期内，由于不可控制的市场及环境变化，创设机构可能出现经营状况不佳或创设机构的现金流与预期发生一定的偏差，从而影响信用衍生品结算的风险。价格波动风险是由于创设机构或所受保护债券主体经营情况出现变化，导致信用评级机构调整对创设机构或所保护债券的信用级别，引起信用衍生品交易价格波动，从而影响投资者的利益的风险。

#### 13、基金财产投资运营过程中的增值税

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人与基金托管人可能通过本基金财产账户直接缴付，或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

## (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](http://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