

平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2021 年 11 月 5 日

送出日期：2021 年 11 月 6 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 | 平安沪深 300 指数量化增强 | 基金代码 | 005113 |
| 下属基金简称 | 平安沪深 300 指数量化增强 A | 下属基金交易代码 | 005113 |
| 下属基金简称 | 平安沪深 300 指数量化增强 C | 下属基金交易代码 | 005114 |
| 基金管理人 | 平安基金管理有限公司 | 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 12 月 26 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 | 俞瑶 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021 年 11 月 04 日 |
| | | 证券从业日期 | 2009 年 10 月 08 日 |
| 基金经理 | 毛时超 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020 年 5 月 9 日 |
| | | 证券从业日期 | 2016 年 07 月 05 日 |
| 其他 | 无 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

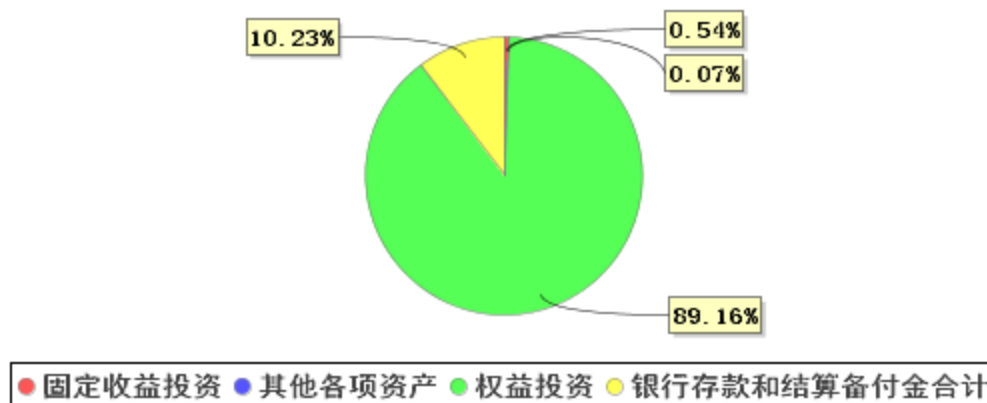
| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。 |
| 投资范围 | 本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数。本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债）、可交换债券等）、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、权证、股指期货、国债期货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相关规定）。本基金可以参与融资和转融通证 |

| | |
|---------------|--|
| | 券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成分股及其备选成分股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国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持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%。 |
| 主要投资策略 | 本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过全样本复制的方式拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理，以达到或超越具有良好市场代表性、流动性与投资性的沪深 300 指数的收益率水平，为投资者提供一个有效分享中国经济持续增长过程中带来的系统性投资机会。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |

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

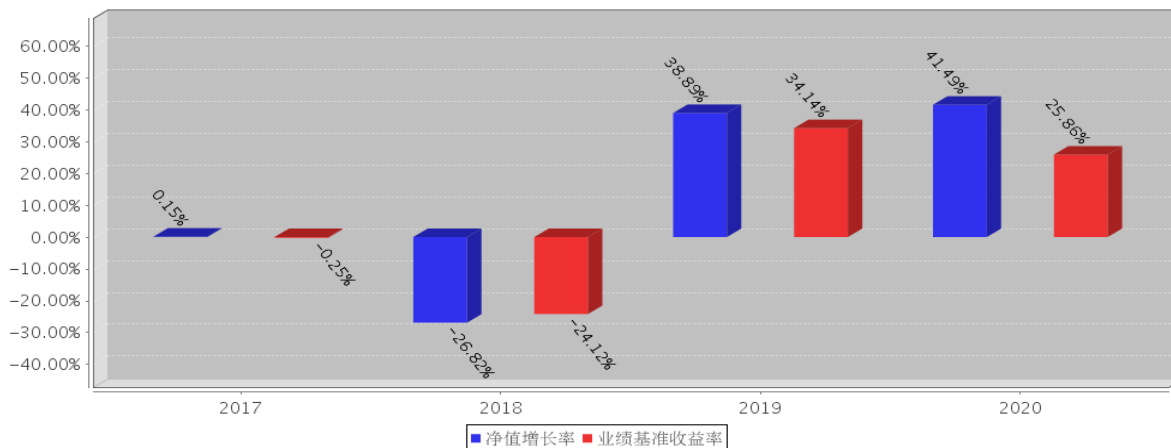
投资组合资产配置图表 (2021年9月30日)



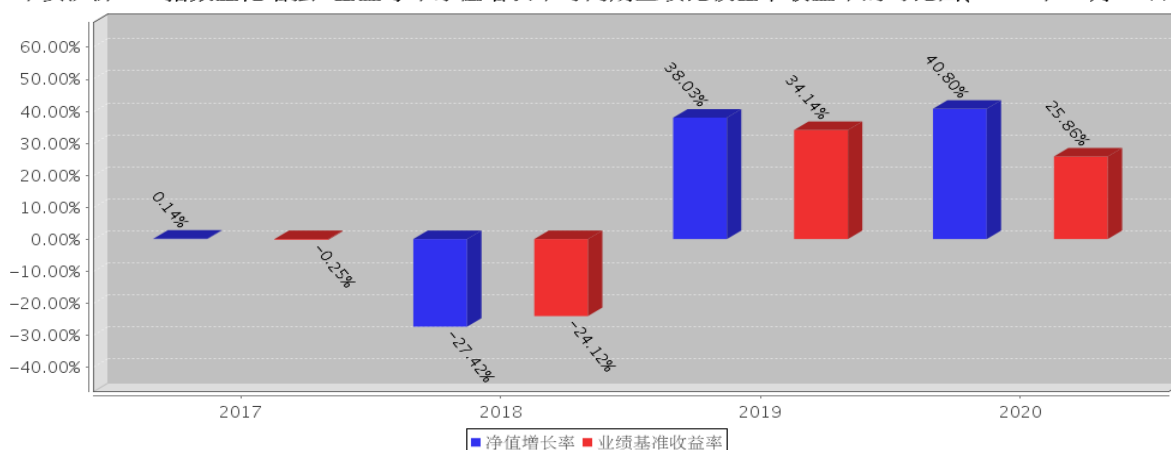
注：由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

(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

平安沪深300指数量化增强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)



平安沪深300指数量化增强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 2017 年 12 月 26 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:

平安沪深 300 指数量化增强 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 (前收费) | M<100 万元 | 1.20% |
| | 100 万元≤M<500 万元 | 0.80% |
| | 500 万元≤M<1000 万元 | 0.30% |
| | 1000 万元≤M | 1,000 元/笔 |
| 赎回费 | N<7 天 | 1.50% |
| | 7 天≤N<1 年 | 0.50% |
| | 1 年≤N<2 年 | 0.20% |
| | 2 年≤N<3 年 | 0.10% |
| | N≥3 年 | 0.00% |

平安沪深 300 指数量化增强 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 | 1.50% |
| | 7 天≤N<30 天 | 0.10% |
| | N≥30 天 | 0.00% |

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 | 1% | |
| 指数许可使用费 | 0.016% | |
| 托管费 | 0.1% | |
| 销售服务费 | 平安沪深 300 指数量化增强 C | 0.5% |
| 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。

本基金 A 类份额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。

投资于本基金的主要风险包括:1、市场风险;2、流动性风险;

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。3、操作或技术风险;4、政策变更风险等。

投资于本基金的特有风险包括:标的指数波动风险、标的指数变更风险、标的指数跟踪误差、指数编制机构停止服务的风险、标的指数成分股停牌的风险、股指期货投资风险、国债期货投资风险、中小企业私募债券投资风险、资产支持证券的投资风险、参与融资与转融通业务的风险、科创板的投资风险等。

另外,本基金为指数增强基金,在控制组合跟踪误差的基础上力求获得超越标的指数的收益,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。

(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华南国际经济贸易仲裁委员会,按照华南国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。

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