

平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024 年 1 月 9 日

送出日期：2024 年 1 月 10 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 2000 增强策略 ETF | 基金主代码 | 159556 |
| 基金管理人 | 平安基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 12 月 27 日 | 上市交易所及上市日期 | 深圳证券交易所 2024 年 1 月 10 日 |
| 基金类型 | 股票型 | 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 | 钱晶 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023 年 12 月 27 日 |
| | | 证券从业日期 | 2011 年 6 月 1 日 |
| 基金经理 | 俞瑶 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023 年 12 月 27 日 |
| | | 证券从业日期 | 2009 年 10 月 8 日 |
| 其他 | 1. 场内简称：中证 2000ETF 增强 | | |

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，在力求对中证 2000 指数进行有效跟踪的基础上，通过科学的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，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。 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于中证 2000 指数的成份股及其备选成份股（包括存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票、存托凭证）、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、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品、银行存款（协议存款、通知存款以及定期存款等）、同业存单、资产支持证券、债券回购、现金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）。 本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。未来在法 |

| | |
|----------------------|--|
| | <p>律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。</p> <p>如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票、存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及其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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，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>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，本基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整投资范围和投资比例规定。</p> |
| <p>主要投资策略</p> | <p>本基金采用指数增强策略，在标的指数成份券权重的基础上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> <p>本基金将以量化多因子模型构建股票组合。本模型通过量化的方式，配置一批具有显著选股效用的、逻辑互补的、相关性低的因子，进而得到具有稳定超额回报的股票组合。本基金定时进行绩效归因评价，对因子的有效性进行持续的跟踪，实现对于模型的动态风险管理。基金经理根据市场状况结合因子变化趋势，对模型使用的因子结构进行动态调整。</p> <p>在正常情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致基金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、跟踪误差的进一步扩大。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>中证 2000 指数收益率</p> |
| <p>风险收益特征</p> | <p>本基金属于股票型基金，其预期的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。</p> |

注：详见本基金招募说明书“基金的投资”章节。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

注：无。

（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：无。

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：

注：

- 1、投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。
- 2、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 |
|------|------------------------------|
| 管理费 | 0.50% |
| 托管费 | 0.10% |
| 其他费用 | 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费等 |

注：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。

本基金的主要风险包括市场风险、管理风险、流动性风险、职业道德风险、合规性风险、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、本基金的特定风险和其他风险。

本基金属于股票型基金，其预期的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。

（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，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据其当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

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