

平安中证沪港深线上消费主题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 5 月 20 日

送出日期：2024 年 5 月 31 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	平安中证沪港深线上消费主题 ETF	基金代码	159793
基金管理人	平安基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2021 年 11 月 9 日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2021 年 11 月 24 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	刘洁倩	开始担任本基金基金经理的日期	2021 年 11 月 09 日
		证券从业日期	2013 年 7 月 1 日
其他	场内简称：线上消费 ETF 平安		

二、基金投资与净值表现

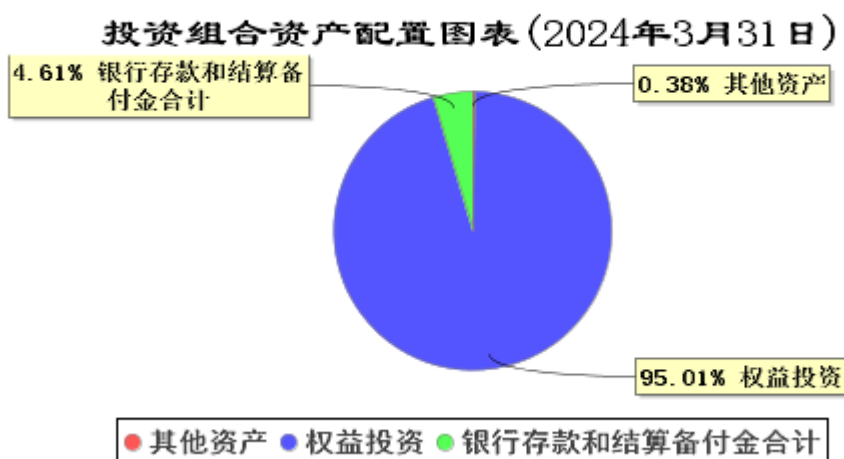
(一) 投资目标与投资策略

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金主要投资于中证沪港深线上消费主题指数的成份股及其备选成份股（包括存托凭证、港股通标的股票）。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、创业板及其他中国证监会允许投资的股票、存托凭证、港股通标的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、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、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）。在条件许可的情况下，根据相关法律法规，本基金可参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。本基金投资于中证沪港深线上消费主题指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金不主动投资于上述投资范围以外的资产，但若因投资于港股通标的股票而被动获得相应港股的认购权利凭证，基金管理人将按照维护基金份额持有人利益最大化的原则，在其可变现或可处置之日起 10 个港股通交易日内进行卖出或相应处置。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。

主要投资策略	1、 股票（含存托凭证）投资策略 本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 2、 债券和货币市场工具投资策略 3、 金融衍生品投资策略 （1）股指期货投资策略 （2） 国债期货投资策略 （3） 股票期权投资策略 4、 资产支持证券投资策略 5、 融资与转融通证券出借业务投资策略
业绩比较基准	中证沪港深线上消费主题指数收益率
风险收益特征	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。同时本基金为交易型开放式指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。本基金投资于香港证券市场上市的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

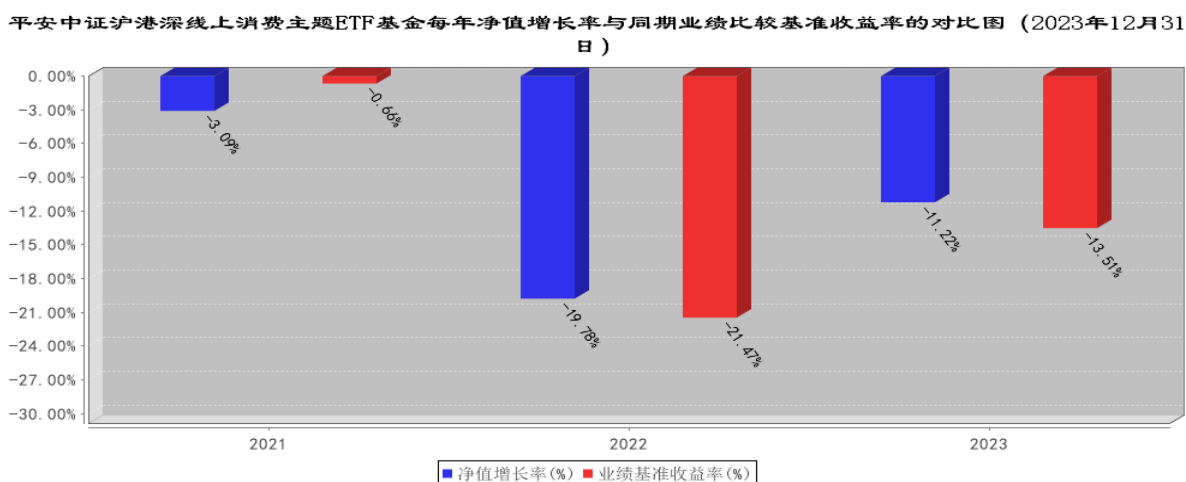
注：详见本基金招募说明书第十一部分“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



注：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



注：1、数据截止日期为 2023 年 12 月 31 日。
 2、本基金基金合同于 2021 年 11 月 9 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

注：1、投资者在申购基金份额时，申购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、登记机构等收取的相关费用。

2、投资者在赎回基金份额时，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、登记机构等收取的相关费用。

3、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/年费率或金额	收取方
管理费	0.5%	基金管理人和销售机构
托管费	0.1%	基金托管人
审计费用	30,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	50,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	按照有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。	

注：

1、相关费用金额为基金整体承担费用，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。

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。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	1.14%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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、职业道德风险、合规性风险、本基金特定风险、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、上海证券交易所上市的成份股可以现金替代方式的风险及其他风险等。

本基金的特定风险：

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

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、上市公司经营状况、投资者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、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、标的指数变更的风险

6、指数编制机构停止服务的风险

7、投资港股通股票的风险：

（1）港股交易失败风险

（2）汇率风险

（3）境外市场的风险

8、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

9、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

10、退市风险

11、成份股停牌的风险

12、投资者申购失败的风险

13、投资者赎回失败的风险

14、基金份额赎回对价的变现风险

15、套利风险

16、申购赎回清单差错风险

17、二级市场流动性风险

18、第三方机构服务的风险

19、退补现金替代方式的风险

20、资产支持证券的投资风险

21、股指期货、国债期货、股票期权投资风险

22、参与融资与转融通证券出借业务的风险

23、投资流通受限证券的风险

24、本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，

（六）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

（七）流动性风险

1、基金申购、赎回安排

2、拟投资市场及资产的流动性风险评估

3、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

（八）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，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。

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