平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书(摘要)更新

(上接 17 版)

五、基金的类型

指数型、联接基金

六、基金的运作方式

契约型开放式

七、基金的投资

一、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。

二、投资范围

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核准上市的股票)、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)、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、权证、股指期货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。

本基金可以在履行适当程序后,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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

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%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

三、投资策略

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。

(一)资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,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,并将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于目标 ETF。为更好地实现投资目标,本基金其余资产可少量投资于非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货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。

(二)目标 ETF 投资策略

本基金投资目标 ETF 有如下两种方式:

(1)申购和赎回:目标 ETF 开放申购赎回后,以股票组合进行申购赎回或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其他方式申赎目标 ETF。

(2)二级市场方式:目标 ETF 上市交易后,在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。

当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。

在投资运作过程中,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申赎的方式或二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。

(三)成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标 ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

(四)债券投资策略

在选择债券品种时,首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中,采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式,获取超额的投资收益。

(五)权证投资策略

本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

(六)股指期货等投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪对标的指数的目的。

(七)资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%;

(2)每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)若本基金参与股指期货交易的,在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%,其中,有价证券指目标 ETF、股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

(4)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;

(5)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;

(6)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

(7)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;

(8)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;

(9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;

(10)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

(11)本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(12)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;

(14)基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(15)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(16) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(1)、(2)、(11)、(15)、(16)项另有约定外,由于证券、期货市场波动、证券发行人合并或基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌或交收延迟等基金管理人之外的原因导致的投资比例不符合上述约定的比例,基金管理人应在 10 个交易日内进行调整;由于证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌或交收延迟等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合第(1)项规定的比例,基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整,以达到规定的投资比例限制要求,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖除目标 ETF 以外的其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

五、标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际指数(MSCI China A International Index)。

本基金业绩比较基准为标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。业绩比较基准与投资比例相符。

如果指数编制单位变更或停止标的的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为原标的指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,在按监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在规定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

若基金标的指数发生变更,基金业绩比较基准随之变更,基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重,调整业绩比较基准应取得基金托管人同意后,报中国证监会备案,基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会规定媒介上刊登公告。

六、风险收益特征

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。

七、基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;

2、有利于基金资产的安全与增值;

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使权利,保护基金份额持有人的利益。

八、目标 ETF 发生相关变更情形时的处理

目标 ETF 出现下述情形之一的,本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金;若届时本基金管理人已有跟踪该标的指数的指数基金,则本基金将本着维护投资者合法权益的原则,履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地,本基金基金合同中将删除关于目标 ETF 的表述部分,或将变更标的指数,届时将由基金管理人另行公告。

1、目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现;

2、目标 ETF 终止上市;

3、目标 ETF 基金合同终止;

4、目标 ETF 与其他基金进行合并;

5、目标 ETF 的基金管理人发生变更(但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人相同的除外);

6、中国证监会规定的其他情形。

若目标 ETF 变更标的指数,本基金将相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。但目标 ETF 召开基金份额持有人大会审议变更目标 ETF 标的指数事项的,本基金的基金份额持有人可出席目标 ETF 基金份额持有人大会并进行表决,目标 ETF 基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的,本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标 ETF 的联接基金。

九、投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 3 月 31 日,本财务数据未经审计。

1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,073,060.40	1.02
	其中:股票	1,073,060.40	1.02
2	基金投资	95,549,619.55	90.75
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,368,488.13	6.05
8	其他资产	2,303,040.77	2.19
9	合计	105,294,208.85	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,725.00	0.00
B	采矿业	47,122.00	0.04
C	制造业	459,419.00	0.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,356.00	0.04
E	建筑业	40,794.00	0.04
F	批发和零售业	40,249.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	43,837.00	0.04
H	住宿和餐饮业	3,752.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,636.00	0.05
J	金融业	263,062.40	0.25
K	房地产业	35,400.00	0.03
L	租赁和商务服务业	7,713.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	9,049.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,407.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	3,447.00	0.00
S	综合	2,102.00	0.00
	合计	1,073,060.40	1.02

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票。

1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603288	海天味业	200	25,034.00	0.02
2	600900	长江电力	1,300	22,477.00	0.02
3	600745	闻泰科技	200	20,300.00	0.02
4	601166	兴业银行	1,200	19,092.00	0.02
5	600000	浦发银行	1,800	18,270.00	0.02
6	600585	海螺水泥	300	16,530.00	0.02
7	601398	工商银行	3,200	16,480.00	0.02
8	603501	韦尔股份	100	15,590.00	0.01
9	601288	农业银行	4,400	14,828.00	0.01
10	600030	中信证券	600	13,296.00	0.01

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末无债券投资情况。

1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF	股票型	交易型开放式	平安基金管理有限公司	95,549,619.55	91.17

1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

1.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

1.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

1.12 投资组合报告附注

1.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本组合投资的前十名证券之一兴业银行,北京银保监局于 2019 年 10 月 8 日做出京银保监罚决字〔2019〕41 号,由于兴业银行北京分行:违规向房地产开发企业提供融资、违规通过同业投资规避监管指标、违规修改理财协议文本、违规向企业权益性投资提供融资、违规向普通客户销售投向非上市公司股权的理财产品。根据相关规定责令兴业银行北京分行改正,并给予合计 600 万元罚款的行政处罚。

本组合投资的前十名证券之一农业银行,中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 3 月 9 日做出银保监罚决字〔2020〕3 号,由于中国农业银行股份有限公司:违反审慎经营规则;虚假代理业务。根据相关规定对公司罚款合计 200 万元。

本组合投资的前十名证券之一浦发银行,银保监会于 2019 年 6 月 24 日做出银保监罚决字〔2019〕7 号,由于上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“公司”):(一)对成都分行授信业务及整改情况严重失察;(二)重大审计发现未向监管部门报告;(三)轮岗制度执行不力。根据相关规定对公司罚款 130 万元。

本组合投资的前十名证券之一闻泰科技,于 2019 年 8 月 16 日收到上交所《关于对闻泰科技股份有限公司及有关责任人予以通报批评的决定》,主要违法违规事实为:一、公司实施重大资产重组未按规定履行内部决策程序,也未履行相应信息披露义务;二、公司办理重大资产重组停复牌事项不审慎;三、未按期披露重组预案、草案等相关信息披露文件,未及时回复重组草案、预案问询函。

对上述股票的投资决策程序的说明:本基金为指数基金,为有效跟踪标的指数,控制跟踪偏离和跟踪误差,对该证券的投资属于按照指数成份股的权重进行配置,符合指数基金的管理规定,该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

1.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,055.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,253.59
5	应收申购款	2,287,731.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,303,040.77

1.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

1.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

1.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

八、基金业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、自基金合同生效以来(2018 年 6 月 21 日)至 2020 年 3 月 31 日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

MSCI 国际联接 A

阶段	份额净值增长①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.6.21-2018.12.31	-11.33%	1.21%	-16.25%	1.42%	4.92%	-0.21%
2019.1.1-2019.12.31	37.00%	1.15%	32.74%	1.16%	4.26%	-0.01%
2020.1.1-2020.3.31	-6.91%	1.82%	-7.11%	1.86%	0.20%	-0.04%
自基金合同生效起至今	13.08%	1.28%	3.27%	1.36%	9.81%	-0.08%

MSCI 国际联接 C

阶段	份额净值增长①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.6.21-2018.12.31	-11.39%	1.21%	-16.25%	1.42%	4.86%	-0.21%
2019.1.1-2019.12.31	36.76%	1.15%	32.74%	1.16%	4.02%	-0.01%
2020.1.1-2020.3.31	-6.95%	1.82%	-7.11%	1.86%	0.16%	-0.04%
自基金合同生效起至今	12.76%	1.28%	3.27%	1.36%	9.49%	-0.08%

本基金业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际指数×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

二、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金基金合同于 2018 年 6 月 21 日正式生效;

2、按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末本基金已完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

九、基金的费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券、期货交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金相关账户的开户及维护费用;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额(若为负数,则取 0)的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H = E × 0.50% ÷ 当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产(若为负数,则 E 取 0)

基金管理费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额(若为负数,则取 0)的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H = E × 0.10% ÷ 当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额(若为负数,则取 0)

基金托管费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

3、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.10%年费率计提。计算方法如下:

H = E × 0.10% ÷ 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。基金管理人根据与销售机构签订的销售协议中约定的付款周期分别划付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第 4-10 项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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。

十、其他应披露事项

本基金 2019 年 6 月 21 日至 2020 年 6 月 20 日发布的公告:

2019年6月30日	平安基金管理有限公司2019年6月30日基金净值披露公告
2019年7月4日	关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构的公告
2019年7月9日	关于子公司深圳平安大华汇通财富管理有限公司名称变更的公告
2019年7月16日	平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金2019年第2季度报告
2019年7月19日	关于旗下部分基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构的公告
2019年8月2日	平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书更新(2019年第1期)-正文
2019年8月2日	平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书更新(2019年第1期)-摘要
2019年8月14日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增喜鹊财富基金销售有限公司为销售机构的公告
2019年8月20日	平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告
2019年8月23日	平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金2019年半年度报告(摘要)
2019年8月23日	平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金2019年半年度报告
2019年8月26日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西藏东方财富证券股份有限公司为销售机构的公告
2019年10月25日	平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金2019年第3季度报告
2019年11月28日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金基金销售有限公司为销售机构的公告
2019年12月5日	平安基金管理有限公司关于旗下基金所持东旭光电(代码:000413)估值调整的公告
2019年12月27日	关于旗下12只基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订相关法律文件的公告
2019年12月27日	平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同
2019年12月27日	平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书更新(2019年12月)
2019年12月27日	平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书更新摘要(2019年12月)
2019年12月27日	平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议
2020年1月10日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告
2020年1月20日	平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金2019年第4季度报告
2020年2月20日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京蛋卷基金销售有限公司为销售机构的公告
2020年2月20日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海好买基金销售有限公司为销售机构的公告
2020年2月20日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增珠海盈米基金销售有限公司为销售机构的公告
2020年2月24日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京苏宁基金销售有限公司为销售机构的公告
2020年2月26日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京虹点基金销售有限公司为销售机构的公告
2020年2月29日	平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告
2020年3月27日	平安基金管理有限公司关于延期披露旗下基金2019年年度报告的公告
2020年4月7日	平安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换、定投起点及账户最低持有份额下限的公告
2020年4月22日	平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金2020年第1季度报告
2020年4月24日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构的公告
2020年5月6日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信证券华南为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告
2020年5月22日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告

注:其他披露事项详见基金管理人发布的相关公告

十一、对招募说明书更新部分的说明

依据《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规的规定,对 2019 年 12 月 27 日公布的《平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书更新(2019 年 12 月)》进行了更新,本次主要更新内容如下:

1、根据最新资料,更新了“重要提示”部分。

2、根据最新资料,更新了“二、释义”。

3、根据最新资料,更新了“三、基金管理人”。

4、根据最新资料,更新了“四、基金托管人”。

5、根据最新资料,更新了“五、相关服务机构”。

6、根据最新资料,更新了“八、基金份额的申购和赎回”。

7、根据最新资料,更新了“九、基金的投资”。

8、根据最新资料,更新了“十、基金业绩”。

9、根据最新资料,更新了“十三、基金的收益与分配”。

10、根据最新资料,更新了“十五、基金的会计与审计”。

11、根据最新资料,更新了“十六、基金的信息披露”。

12、根据最新资料,更新了“十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”。

13、根据最新资料,更新了“十九、基金合同的内容摘要”。

14、根据最新资料,更新了“二十、基金托管协议的内容摘要”。

15、根据最新资料,更新了“二十二、其他应披露事项”。

16、根据最新情况,更新了“二十三、对招募说明书更新部分的说明。”

平安基金管理有限公司

2020 年 8 月 1 日

证券代码:002862 证券简称:实丰文化 公告编号:2020-039

实丰文化发展股份有限公司
关于与专业投资机构合作的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

特别提示:

1、本次签署的合作协议对公司 2020 年经营业绩暂不构成重大影响。

一、合作协议的基本情况

(一)协议签订的基本情况

实丰文化发展股份有限公司(以下简称“公司”、“实丰文化”或“甲方”)与宁波梅山保税港区顶播股权投资管理有限公司(