

平安 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 11 月 18 日

送出日期：2024 年 11 月 29 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 CFETS0-3 年期政金债指数	基金代码	021507
下属基金简称	平安 CFETS0-3 年期政金债指数 A	下属基金交易代码	021507
下属基金简称	平安 CFETS0-3 年期政金债指数 C	下属基金交易代码	021508
基金管理人	平安基金管理有限公司	基金托管人	中国光大银行股份有限公司
基金合同生效日	2024 年 6 月 26 日	上市交易所及上市日期	-
基金类型	债券型	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	张璐	开始担任本基金基金经理的日期	2024 年 6 月 26 日
		证券从业日期	2013 年 7 月 15 日
其他	无		

二、基金投资与净值表现

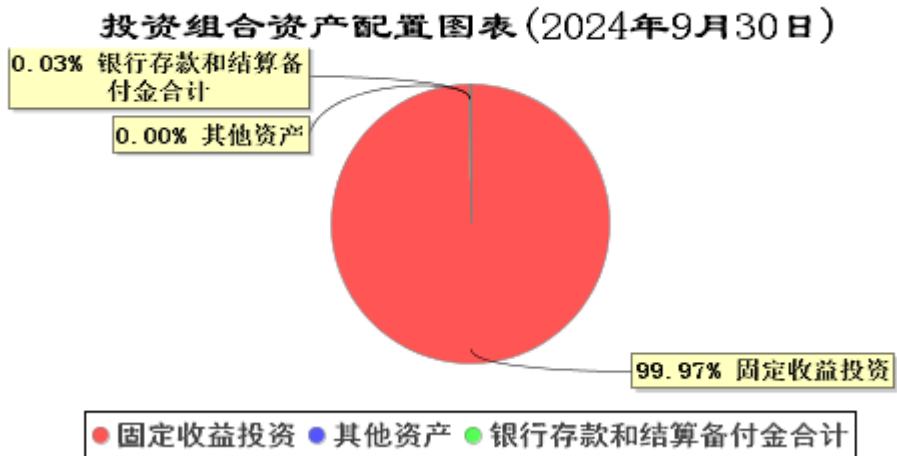
(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金通过指数化投资，力争获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。
投资范围	<p>本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券。为了更好地实现投资目标，本基金还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的国债、政策性金融债、央行票据、债券回购、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）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。</p> <p>本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券、资产支持证券、企业债、公司债、可交换债券。</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，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；其中投资于待偿期为 0 年-3 年（包含 3 年）的标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金</p>

	资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 如果法律法规或中国证监会以后允许变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。 标的指数为 CFETS 0-3 年期政策性金融债指数。
主要投资策略	本基金为指数基金，采用优化抽样复制法。 通过对标的指数中各成份债券的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的债券构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。
业绩比较基准	CFETS 0-3 年期政策性金融债指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。 本基金跟踪 CFETS 0-3 年期政策性金融债指数，主要投资于标的指数成份券及备选成份券，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。

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



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：无。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

平安 CFETS0-3 年期政金债指数 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)	$M < 1,000,000$	0.50%
	$1,000,000 \leq M < 2,000,000$	0.30%

赎回费	2,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.15%
	M ≥ 5,000,000	1,000 元/笔
	N < 7 天	1.50%
	N ≥ 7 天	0.00%

平安 CFETS0-3 年期政金债指数 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%
	N ≥ 7 天	0.00%

注: 1、C 类基金份额不收取认购费、申购费。

2、投资人重复认购、申购, 须按每次认、申购所对应的费率档次分别计费。

3、本基金认购、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。

## (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	0.15%		基金管理人和销售机构
托管费	0.05%		基金托管人
销售服务费	平安 CFETS0-3 年期政金债指数 C	0.1%	销售机构
审计费用	85,000.00 元		会计师事务所
信息披露费	70,000.00 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: 相关费用金额为基金整体承担费用, 非单个份额类别费用, 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。

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。

## (三) 基金运作综合费用测算

注: 无。

## 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:

1、市场风险; 2、信用风险; 3、流动性风险; 4、操作风险; 5、管理风险; 6、合规风险; 7、本基金的特有风险包括: 指数化投资相关的风险、标的指数的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份券停牌的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险等。

8、本基金主要投资于政策性金融债, 可能面临风险包括: 政策性银行改制后的信用风险、政策性金融债流动性风险、投资集中度风险。

9、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。

## (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深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。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