平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要

基金管理人:平安基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
截止日期:2020年1月

【重要提示】

平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经2019年9月30日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1820号文准予募集注册。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。证券投资基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。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,采用完全复制法跟踪标的指数表现,具有与中证新能源汽车产业指数以及其所代表的股票相似的风险收益特征。

证券投资基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、基金中基金、货币市场基金等不同类型,投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资人承担的风险也越大。

因折算、分红等行为导致基金份额净值变化,不会改变基金的风险收益特征,不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。本基金以1.00元发售面值开展基金募集,或因折算、分红等行为导致基金份额净值调整至1.00元发售面值或1.00元附近, 在市场波动等因素的影响下,基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于发售面值。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,并承担基金投资中出现的各类风险,包括市场风险、管理风险、职业道德风险、合规风险、本基金特有风险及其他风险等。特有风险包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、二级市场流动性风险、退市风险、第三方机构服务的风险等。在目前结算规则下,投资者申购的基金份额当日起可卖出,投资者赎回获得的股票当日起可卖出。因此为投资者办理申购业务的代理券商若发生交收违约,将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额,投资者的利益可能受到影响。

为对冲信用风险,本基金可能投资于信用衍生品。信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同等信息披露文件,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

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,本基金管理人不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。

本基金本次更新的招募说明书主要对基金的指数许可使用费相关内容进行了更新。2020年1月17日依据《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》(2020年修订)的规定对本招募说明书相关信息进行更新,基金经理相关信息截止日期为2020年1月10日。截至本招募说明书公告日,本基金无已披露的投资组合报告和净值表现数据。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:平安基金管理有限公司
住所:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
法定代表人:罗春风
设立日期:2011年1月7日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可【2010】1917号
组织形式:有限责任公司(中外合资)
注册资本:人民币130,000万元
存续期间:持续经营
联系人:吴小红
联系电话:0755-22623179
股东名称、股权结构及持股比例:

股东名称	出资额(万元)	出资比例
平安信托有限责任公司	88,647	68.19%
大华资产管理有限公司	22,763	17.51%
三亚盈湾旅业有限公司	18,590	14.30%
合计	130,000	100%

基金管理人无任何重大行政处罚记录。
客服电话:400-800-4800(免长途话费)
(二)主要人员情况
1、董事、监事及高级管理人员
(1)董事会成员
罗春风先生,董事长,博士,高级经济师。1966年生。曾任中华全国总工会国际部干部,平安保险集团办公室主任助理、平安人寿广州分公司副总经理、平安人寿总公司人事行政部/培训部总经理、平安保险集团品牌宣传部总经理、平安人寿北京分公司总经理、平安基金管理有限公司副总经理、平安基金管理有限公司总经理。现任平安基金管理有限公司董事长兼任深圳平安汇通投资管理有限公司执行董事。
姚波先生,董事,硕士,1971年生。曾任R.J.MichalskiInc.(美国)养老金咨询分析员、GuardianLifeIns.Co(美国)助理精算师、SwissRe(美国)精算师、DeloitteActuarialConsultingLtd.(香港)精算师、中国平安保险(集团)股份有限公司副总精算师、总经理助理等职务,现任中国平安保险(集团)股份有限公司常务副总经理兼首席财务官兼总精算师。
陈敬达先生,董事,硕士,1948年生,新加坡。曾任香港罗兵咸会计师事务所审计师;新鸿基证券有限公司执行董事;DBS唯高达香港有限公司执行董事; 平安证券有限责任公司副总经理;平安证券有限责任公司副董事长/副总经理;平安证券有限责任公司董事长;中国平安保险(集团)执行委员会执行顾问,现任集团投资管理委员会副主任。
肖宇鹏先生,董事,学士,1970年生。曾任职于中国证监会系统、平安基金管理有限公司督察长。现任平安基金管理有限公司总经理。
杨玉萍女士,董事,学士,1983年生。曾于平安数据科技(深圳)有限公司从事运营规划,现任平安保险(集团)股份有限公司人力资源中心薪酬规划管理部高级人力资源经理。
叶杨诗明女士,董事,硕士,1961年生,加拿大籍。曾任职于澳新银行、渣打银行、汇丰银行并担任高级管理职务。2011年加入大华银行集团,现任大华银行有限公司董事总经理兼香港区总裁兼大华银行(中国)有限公司非执行董事,同时兼任瑞士德科集团顾问、崇侨托管(香港)有限公司董事、数码通电讯集团独立非执行董事、UnitedInvestmentsPrivateLtd董事、UnitedOrientCapitalG.P.Ltd董事、大华银行托管(香港)有限公司董事、UnitedPteEquityInvestments(Cayman)Ltd董事、新加坡大华亚洲(香港)有限公司董事、大华投资管理(上海)有限公司董事。
张文杰先生,董事,学士,1964年生,新加坡。现任大华资产管理有限公司执行董事及首席执行长,新加坡投资管理协会执行委员会委员。历任新加坡政府投资公司“特别投资部门”首席投资员,大华资产管理有限公司组合经理,国际股票和全球科技团队主管。
薛世峰先生,独立董事,硕士,1963年生。曾任江西省行政学院老师、深圳市龙岗镇投资管理公司投资部部长、龙岗实业股份有限公司总经理、法定代表人、深圳市鑫德莱实业有限公司总经理助理兼房地产部部长、监事会主席、法律顾问,后加入广东万乘律师事务所任专职律师,现任广东宏泰律师事务所高级合伙人、专职律师。
李娟娟女士,独立董事,学士,1965年生。曾任安徽商业高等专科学校教师、深圳兴粤会计师事务所项目经理、深圳职业技术学院经济系教师、会计专业主任、深圳职业技术学院计财处处长;现任深圳职业技术学院经济学院副院长。
刘雪生先生,独立董事,硕士,1963年生。曾任深圳蛇口中华会计师事务所审计员、深圳华侨城集团会计师、财务经理、子公司副总经理、总会计师、深圳市注册会计师协会部门临时负责人、秘书长助理;现任深圳市注册会计师协会副秘书长。
潘汉腾先生,独立董事,学士,1949年生。曾任新加坡赫乐财务有限公司助理经理、新加坡花旗银行副总裁、新加坡大华银行高级执行副总裁;现任彩日本科理私人有限公司非执行董事、一合环保控股有限公司独立董事、速美建筑集团有限公司独立董事、华业集团有限公司独立董事。
(2)监事会成员
巢傲文先生,监事长,硕士,1967年生。曾任江西客车厂科室助理工程师;深圳市龙岗区投资管理公司经济研究部科员;平安银行(原深圳发展银行)营业部柜员、副主任、支行会计部副主任、总行电脑部规划室经理、总行零售银行部综合室经理、总行稽核部零售稽核室主管、总行稽核部总经理助理;广东南粤银行总行稽核监察部副总经理(主持工作)、总行人力资源部总经理、惠州分行筹建办主任、分行行长、总行稽核部总经理;现任职于中国平安保险(集团)股份有限公司稽核监察部总经理室,兼任重庆金融资产交易所监事会主席。
冯方女士,监事,硕士,1975年生,新加坡。曾任职于淡马锡控股和旗下的富敦资产管理公司以及新加坡毕盛资产公司、鼎崴资本管理公司。于2013年加入大华资产管理,现任区域总办公室主管。
郭晶女士,监事,硕士,1979年生。曾任广东溢达集团研发总监助理、侨鑫集团人力资源管理岗;现任平安基金管理有限公司人力资源室副经理。
李峥女士,监事,硕士,1985年生。曾任德勤华永会计师事务所高级审计员、深圳市宝能投资集团财务部会计主管,现任平安基金管理有限公司监察稽核岗。
(3)公司高级管理人员
罗春风先生,博士,高级经济师。1966年生。曾任中华全国总工会国际部干部,平安保险集团办公室主任助理、平安人寿广州分公司副总经理、平安人寿总公司人事行政部/培训部总经理、平安保险集团品牌宣传部总经理、平安人寿北京分公司总经理、平安基金管理有限公司副总经理、平安基金管理有限公司总经理,现任平安基金管理有限公司董事长兼任深圳平安汇通投资管理有限公司执行董事。
肖宇鹏先生,学士,1970年生。曾任职于中国证监会系统、平安基金管理有限公司督察长;现任平安基金管理有限公司总经理。
林婉文女士,1969年生,毕业于新加坡国立大学,拥有学士和荣誉学位,新加坡籍。曾任新加坡国防部职员,大华银行集团助理经理、电子渠道负责人、个人金融部投资产品销售主管、大华银行集团行长助理,大华资产管理公司大中华区业务开发主管,高级董事。现任平安基金管理有限公司副总经理。
汪涛先生,1976年生,毕业于谢菲尔德大学,金融硕士学位。曾任上海赛宁国际贸易有限公司销售经理、汇丰银行上海分行市场代表、新加坡华侨银行产品经理、渣打银行产品主管、宁波银行总行个人银行部总经理助理、总行审计部副总经理、总行资产托管部副总经理、永赢基金管理有限公司督察长。现任平安基金管理有限公司副总经理。
陈特正先生,督察长,学士,1969年生。曾任深圳发展银行龙岗支行行长助理,龙华支行副行长、龙岗支行副行长、布吉支行行长、深圳分行信贷风控部总经理、平安银行深圳分行信贷审批部总经理、平安银行总行公司授信审批部高级审批师、平安银行沈阳分行行长助理兼风控总监。现任平安基金管理有限公司督察长。
2、基金经理
钱晶先生,美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017年10月加入平安基金管理有限公司,任资产配置事业部ETF指数部投资经理。现任平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金(2018-03-26至今)、平安MSCI中国A股低波动交易型开放式指数证券投资基金(2018-06-20至今)、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金(2018-11-06至今)、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(2019-02-28至今)、平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金(2019-02-28至今)、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金(2019-03-15至今)、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金(2019-07-12至今)、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金(2019-12-31至今)基金经理。
3、投资决策委员会成员
本公司投资决策委员会成员包括:总经理肖宇鹏先生,权益投资中心投资董事总经理李化松先生,衍生品投资中心投资执行总经理DANIELDONGNINGSUN先生、研究中心研究执行总经理张晓泉先生、基金经理黄维先生。
肖宇鹏先生,学士,1970年生。曾任职于中国证监会系统、平安基金管理有限公司督察长;现任平安基金管理有限公司总经理。
李化松先生,北京大学经济学硕士,曾先后担任国信证券股份有限公司经济研究所分析师、华宝兴业基金管理有限公司研究部分析师、嘉实基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理。2018年3月加入平安基金管理有限公司,现任平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安核心优势混合型证券投资基金、平安高端制造混合型证券投资基金、平安安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
DANIELDONGNINGSUN先生,北京大学硕士,美国哥伦比亚大学博士,约翰霍普金斯大学博士后。先后担任瑞士再保险自营交易部量化分析师、花旗集团投资银行高级副总裁、瑞士银行投资银行交易量化总监、德意志银行战略科技部量化服务负责人。2014年10月加入平安基金管理有限公司,任衍生品投资中心投资执行总经理。现任平安深证300指数增强型证券投资基金、平安沪深300指数量化增强证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理。
张晓泉先生,清华大学材料科学与工程专业硕士,曾先后担任广发证券股份有限公司研究员、招商基金管理有限公司研究员、国投瑞银基金管理有限公司研究总监助理。2017年10月加入平安基金管理有限公司,任研究中心研究执行总经理,现任平安新鑫先锋混合型证券投资基金基金经理。
黄维先生,北京大学微电子学硕士,2010年7月起先后任广发证券股份有限公司研究员、广发证券资产管理(广东)有限公司投资经理,于2016年5月加入平安基金管理有限公司,现任平安睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金、平安优势产业灵活配置混合型证券投资基金、平安安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
上述人员之间不存在近亲属关系。
(三)基金管理人的职责

1、依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2、办理基金备案手续;
3、自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
7、依法接受基金托管人的监督;
8、编制并公告申购赎回清单,计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购对价、赎回对价;
9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定;
10、按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回对价;
11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
12、编制季度报告、中期报告和年度报告;
13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
14、保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
15、按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
17、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;
18、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
19、组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
20、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
21、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
22、监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务,基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
23、当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
24、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
25、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,基金合同不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人,同时通知登记结算机构将已冻结的股票解冻;
26、执行生效的基金份额持有人大会的决议;
27、建立并保存基金份额持有人名册;
28、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。
(四)基金管理人关于遵守法律法规的承诺
1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生;
2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为,并承诺建立健全的内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:
(1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平地对待管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
(5)侵占、挪用基金财产;
(6)泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;
(8)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。
3、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:
(1)越权或违规经营;
(2)违反基金合同或托管协议;
(3)故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;
(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
(6)玩忽职守、滥用职权,不按照规定履行职责;
(7)泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
(8)协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;
(9)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
(10)贬损同行,以提高自己;
(11)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
(12)以不正当手段谋求业务发展;
(13)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;
(14)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的行为。
(五)基金管理人关于禁止性行为的承诺
为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:
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。
若将来法律、行政法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消, 基金管理人在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。
(六)基金经理承诺
1、依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
2、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;
3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。
(七)基金管理人的内部控制制度
1、内部控制制度概述
为了保证公司规范运作,有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险,确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整,从而最大程度地保护基金份额持有人的利益,本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。
内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。
公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是对各项基本管理制度的总揽和指导,内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。
基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。
部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。
2、内部控制原则
健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。
有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行。
独立性原则。公司各机构、部门、和岗位在职能上应当保持相对独立,公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。
相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡,并通过切实可行的措施来实行。
成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性,运用科学化的方法尽量降低经营运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。
3、主要内部控制制度
(1)内部会计控制制度
公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责,并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。
内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。
(2)风险管理控制制度
风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定,风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。
风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。
(3)监察稽核制度
公司设立督察长,经董事会聘任,报中国证监会相关机构认可。根据公司监察稽核工作的需要,督察长可以列席公司相关会议,调阅公司相关档案,就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况,董事会对督察长的报告进行审议。
公司设立法律合规监察部开展监察稽核工作,并保证法律合规监察部的独立性和权威性。公司明确了法律合规监察部及内部各岗位的具体职责,严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。
法律合规监察部强化内部检查制度, 通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况,促使公司各项经营管理活动的规范运行。
公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作,对违反法律法规和公司内部控制制度的,追究有关部门和人员的责任。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况
1、基本情况
名称:招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路111号
法定代表人:霍达
成立时间:1993年8月1日
组织形式:股份有限公司
注册资本:66.99亿元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:证监许可[2014]78号
联系人:韩鑫普
联系电话:0755-26951111
招商证券是百年招商局旗下金融企业,经过二十多年创业发展,已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商,并经中国证券监督管理委员会评定为A类AA级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力、科学合理的风险管理架构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道,在北京、上海、广州、深圳等城市拥有249家批准设立的证券营业部和12家证券经纪业务管理分公司,同时在香港设有分支机构,全资拥有招商证券国际有限公司、招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司,参股博时基金管理公司、招商基金管理公司、广东股权交易中心股份有限公司及证通股份有限公司,构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力,打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越的金融服务实现客户价值增长,推动证券行业进步,立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构,成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。
2、主要人员情况
招商证券托管部员工多人拥有证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验,以及大型IT公司的软件设计与开发经验,人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域,其中本科以上人员占比100%,高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。
3、基金托管业务经营情况
招商证券是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司,可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施,稳定、高效的托管业务系统,完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实信用、谨慎勤勉”的原则,为基金份额持有人利益履行基金托管职责。 除此之外, 招商证券于2012年10月获得了证监会准许开展私募基金综合托管服务试点的正式批复, 成为业内首家可从事私募托管业务的券商,经验丰富,服务优质,业绩突出。截至2019年四季度,招商证券共托管36只公募基金。
(二)基金托管人的内部控制制度
1、内部控制目标

招商证券作为基金托管人:
(1)托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。
(2)建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系,保持托管业务内部控制制度健全、执行有效。
(3)防范和化解经营风险,提高经营管理效益,使托管业务稳健运行和受托资产安全完整,实现托管业务的持续、稳定、健康发展。
(4)不断改进和完善内控机制、体制和各项业务制度、流程,提高业务运作效率和效果。
2、内部控制组织结构
招商证券股份有限公司经营管理层面设立了风险管理委员会。作为公司内部最高风险决策机构,风险管理委员会负责审议公司风险管理政策、风险偏好、容忍度和经济资本等风险限额配置方案,拥有公司重大风险业务和创新业务项目的最终裁量权。风险管理部、法律合规部及稽核部为公司的风险管理职能部门。
托管部内部设置专门负责稽核工作的内控稽核岗,配备专职稽核人员,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使监督稽核职权。
3、内部控制制度及措施
招商证券托管部制定了各项管理制度和操作规程,建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系,保持托管业务健全、有效执行;安全保管基金财产,保持基金财产的独立性;实行经营场所封闭式管理,并配备录音和录像监控系统;有独立的综合托管服务系统;业务管理实行复核和检查机制,建立了严格有效的操作制约体系;托管部树立内控优先和风险管理的理念,培养部门全体员工的风险防范和保密意识。
(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序
1、监督方法
基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定,对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督,并及时提示基金管理人违规风险。
2、监督程序
基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构
1、发售协调人
发售主协调人详见基金份额发售公告。
2、网下现金和网下股票发售直销机构
名称:平安基金管理有限公司
住所:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
办公地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
法定代表人:罗春风
电话:0755-22627627
传真:0755-23990088
联系人:郑权
网址:www.fund.pingan.com
个人投资者可以通过本基金管理人直销柜台办理本基金的认购等业务,具体交易细则请参阅本基金管理人网站公告。
3、网下现金发售和网下股票发售代理机构
详见基金份额发售公告。
4、网上现金发售代理机构
本基金的发售机构为具有基金代销资格的上海证券交易所会员单位(具体名单可在上海证券交易所网站查询)。
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金。
(二)登记结算机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:戴文华
电话:010-50938782
传真:010-50938991
联系人:赵亦清
(三)出具法律意见书的律师事务所
律师事务所:上海市通力律师事务所
地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:黎明、陈颖华
联系人:陈颖华
(四)审计基金财产的会计师事务所
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
法定代表人:李丹
联系电话:(021)23238888
传真电话:(021)23238000
经办注册会计师:曹翠丽、邓昭君
联系人:邓昭君

四、基金的名称

平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金

六、基金的运作方式

交易型开放式

七、基金的投资

(一)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。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。
(二)投资范围
本基金主要投资于中证新能源汽车产业指数的成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、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、同业存单、资产支持证券、资产支持票据、债券回购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。
本基金投资于中证新能源汽车产业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%。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。
(三)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。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
特殊情况包括但不限于以下情形:(1)法律法规的限制;(2)标的指数成份股流动性严重不足;(3)标的指数的成份股票长期停牌;(4)其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。
为有效管理投资组合,本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品,如股指期货以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资于衍生工具的目标,是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数,以便更好地实现基金的投资目标。
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。
本基金参与资产支持证券投资时,将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时,基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响,综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。
本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则,在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时,本基金将力争利用融资的杠杆作用,降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时,本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上合理确定出借证券的范围、期限和比例,力争为本基金份额持有人增厚投资收益。
本基金参与国债期货的投资应符合基金合同规定的投资策略和投资目标。本基金以套期保值为目的,根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,投资于国债期货合约,有效管理投资组合的系统性风险,积极改善组合的风险收益特征。
本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。
本基金将适当投资信用衍生品及其挂钩债券,以在控制信用风险的前提下提高组合投资收益。在进行信用衍生品投资时,将根据风险管理的原则,以信用套保为主要目的,转移信用衍生品所挂钩债券的信用风险,改善组合的风险收益特性。收益率方面,将通过分析信用衍生品和挂钩债券的合成收益率,选择具备一定信用利差的信用衍生品及其挂钩债券进行投资,并确定信用衍生品及其挂钩债券的投资金额与期限。本基金仅投资于符合证券交易所或银行间市场相关业务规则的信用衍生工具。
(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)本基金投资于标的指数成份股和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%;
(2)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%;
(3)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%;
(4)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%;
(5)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