

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份额发售公告

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

【重要提示】

1、平安中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的发售已获中国证监会2023年9月18日证监许可【2023】2239号文注册。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

2、本基金类别为股票型证券投资基金，运作方式为交易型开放式。

3、本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”，“本公司”），基金托管人为中国民生银行股份有限公司，登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

5、投资者可选择网上现金认购和网下现金认购2种方式。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购。网下现金认购是指投资者通过基金管理人和其指定的发售代理机构使用证券交易所网上系统以外的系统以现金进行的认购。

6、本基金于2023年12月18日至2023年12月22日期间进行发售。其中，网上现金认购的发售日期为2023年12月18日至2023年12月22日。网下现金认购的发售日期为2023年12月18日至2023年12月22日。本基金的募集期限不超过3个月。基金管理人可根据募集情况适当缩短或延长本基金的募集期限并及时公告。

7、投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所A股账户（以下简称“深圳A股账户”）或深圳证券交易所证券投资基金账户（以下简称“深圳证券交易所证券投资基金账户”）。

已有深圳A股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户的投资者不必再办理开户手续。

尚无深圳A股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户的投资者，需在认购前持本人身份证件到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳A股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳A股账户和深圳证券交易所证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

如投资者需要参与网下现金或网上现金认购，应使用深圳A股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户；深圳证券交易所证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。

已购买过由平安基金管理有限公司担任登记结算机构的基金的投资者，其拥有的平安基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

8、本基金认购费用或认购佣金比率不超过0.80%。

9、网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍。投资者可以多次认购，除本公告中募集规模上限规定外，累计认购份额不设上限。

网下现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍；投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在5万份以上（含5万份）。投资者可以多次认购，除本公告中募集规模上限规定外，累计认购份额不设上限。

10、本基金首次募集规模上限为10亿元。

11、网上现金认购可多次申报，不可撤单，申报一经确认，认购资金即被冻结。网下现金认购申请提交后不得撤销。

12、投资者不得非法利用他人账户或资金进行认购，也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

13、投资者应保证用于认购的资金来源合法。对于投资者用于认购的资金，投资者应有权自行支配，不存在任何法律上、合约上或其他障碍。

14、销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构的确认结果以及基金合同生效为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

15、投资者通过网上现金认购和网下现金认购两种方式认购所得的基金份额都属场内份额。

16、对未开设销售网点的地方的投资者，投资人可拨打基金管理人客户服务热线（400—800—4800）、直销专线电话（0755—22627627）或各发售代理机构咨询电话了解认购事宜。

17、基金管理人可综合各种情况对募集期安排做适当调整。

18、本基金仅对“平安中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金”发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解“平安中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金”的详细情况，请详细阅读《平安中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

19、本公告及本基金的基金招募说明书提示性公告、基金合同提示性公告登载在指定报刊，本基金的《基金合同》、《托管协议》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》及本公告将同时登载在指定网站（包括本公司网站：www.fund.pingan.com）和中国证监会基金信息披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上。投资者亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金募集相关事宜。

20、各发售代理机构的代销网点以及开户、认购等事项的详细情况请向各发售代理机构咨询。

基金募集期结束后，基金管理人确定本基金的申购赎回代理机构名单，按规定予以披露。本基金上市后，指定交易未在中购赎回代理机构的投资者只能进行本基金的二级市场买卖，如投资者需进行本基金的申购赎回交易，须指定交易或转指定交易到申购赎回代理机构。

21、风险提示

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，既可按其持有的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。

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。

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。

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、期货市场，基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并自行承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，流动性风险等。

本基金的主要风险包括：（1）指数化投资的风险。包括标的指数波动的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险等；（2）ETF运作的风险。包括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、成份股停牌的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、申购赎回清单差错风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、第三方机构服务的风险、退市风险、二级市场流动性风险、追补现金替代方式的风险等；（3）投资特定品种（包括股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品、资产支持证券、存托凭证、流通受限证券、信用衍生品等）的特有风险；（4）参与融资与转融通证券出借业务的约定等。

本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的规定。本基金的一般风险及特有风险详见招募说明书的“风险揭示”部分。

本基金为增强策略ETF，面临增强策略失效风险，即本基金采用主动管理策略选股，可能存在策略失效，无法战胜指数策略的风险；也面临潜在抢先交易风险，即投资者可依据每日公布的基金持仓信息判断成份股买卖情况，进而抢先于基金组合交易成份股，可能影响基金投资收益。

本基金因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，为更好地实现基金的投资目标，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）。

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、基金合同及基金产品资料概要等信息披露文件，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，本基金管理人不对投资基于本基金一定盈利，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。

22、投资者确认知晓并同意认/申购本基金基金份额的行为即视为同意履行全力配合基金管理人穿透识别最终投资者（穿透识别标准以法律法规、自律规则及相关开户机构的要求为准，下同）的义务，如投资者拒绝配合基金管理人进行穿透识别最终投资者的，基金管理人有权拒绝投资者的认/申购申请，认/申购申请已经确认的，基金管理人有权强制赎回相应的基金份额。

23、本公告解释权归基金管理人。

一、基金募集的基本情况

1.基金名称

平安中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称：平安中证2000增强策略ETF
场内简称：中证2000ETF增强
基金代码：159556

2.基金类型

股票型证券投资基金

3.基金运作方式

交易型开放式

4.基金存续期限

不定期

5.基金份额发售面值

1.00元人民币

6.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。

7.标的指数及业绩比较基准

本基金的标的指数为中证2000指数，本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证2000指数收益率。

8.募集规模上限及控制方案

本基金网上现金认购、网下现金认购（以下简称“现金认购”）的合计首次募集规模上限为人民币10亿元（现金认购不含募集期利息和认购费用，下同）。基金募集过程中认购募集规模接近、达到或超过10亿元人民币的，基金提前结束募集。

（1）现金认购采取“末日比例确认”的方式对上述规模限制进行控制。具体处理方式如下：

在募集期内任何一天（含第一天）当日募集截止时间后如果累计有效认购申请份额总额超过10亿份（折合为金额10亿元人民币），基金管理人将采取末日比例确认的方式实现对现金认购部分规模的有效控制。当发生末日比例确认时，基金管理人将及时公告比例确认情况与结果。未确认部分认购款项将在募集期结束后退还给投资者或予以解冻。

末日认购申请确认比例的计算方法如下：

末日认购申请确认比例=（基金管理人最终接受该产品现金认购份额总额—末日之前有效现金认购申请份额总额）/末日有效现金认购申请份额总额

末日投资者现金认购申请确认份额=末日提交的有效现金认购申请份额×末日认购申请确认比例

“末日之前有效现金认购申请份额总额”和“末日有效现金认购申请份额总额”都不包括募集期利息和认购费用。

当发生末日比例确认时，本基金登记机构按照末日认购申请确认比例对末日每笔有效现金认购申请份额进行部分确认处理。末日现金认购申请确认份额不受认购最低限额的限制。最终认购申请确认结果以本基金登记机构的计算和确认的结果为准。

因对每笔认购明细处理的精度等原因，最终确认的本基金累计有效认购份额（不包括募集期利息和认购费用）可能会略微超过10亿份。若本基金因触发认购募集规模上限而导致提前结束募集的，基金管理人将另行公告，并列明份额配售的处理方式。《基金合同》生效后不受前述募集规模的限制。

9.募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

10.销售相关机构

具体名单见本公告“八、本次募集有关当事人或中介机构”中“（三）基金份额发售机构”。

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，并及时披露。

11、基金募集时间安排、募集规模与基金合同生效

（1）本基金的募集期限为自基金份额发售之日起不超过三个月。

（2）本基金于2023年12月18日至2023年12月22日期间进行发售。其中，网上现金认购的发售日期为2023年12月18日至2023年12月22日。网下现金认购的发售日期为2023年12月18日至2023年12月22日。在发售期内，本基金向个人投资者和机构投资者同时发售。基金管理人可根据认购的情况及市场情况提前结束发售。

（3）本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金份额有效认购人数不少于200人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会备案确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。

（4）基金募集期间，本基金符合法律法规规定的基金合同生效条件的，基金管理人应按照规定在办理基金验资和备案手续后公告基金合同生效。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

募集期间投资者现金认购（包括网下现金认购及网上现金认购）款项所产生的利息归投资者所有，在本基金募集结束后，折算为基金份额计入投资者的账户。

（5）基金募集期届满，未达到基金合同的生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。基金管理人应当以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后30日内退还投资者已交纳的认购款项，并加计银行同期活期存款利息。

二、认购方式与相关规定

1、认购方式
本基金认购采取份额认购的方式。

2、认购费率

本基金的认购费用或认购佣金由认购基金份额的投资者承担，主要用于基金的市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用。投资者可以多次认购本基金，认购费率按每笔认购申请单独计算。

本基金认购费率如下表：

认购份额（S）	认购费率
S<50万份	0.80%
50万份≤S<100万份	0.50%
S≥100万份	每笔1000元

发售代理机构提供网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构，按照不超过认购份额×0.80%的标准收取一定的佣金。

3、认购费用计算公式和收取方式

（1）网上现金认购

本基金认购金额的计算如下：

1）认购佣金适用比例费率时：

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

认购金额=认购价格×认购份额×（1+佣金比率）

净认购金额=认购价格×认购份额

2）认购佣金适用固定费用时：

认购佣金=固定费用

认购金额=认购价格×认购份额+固定费用

净认购金额=认购价格×认购份额

认购佣金由发售代理机构收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资者通过发售代理机构采用网上现金方式认购本基金1,000份，假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.80%，则需准备的资金数额计算如下：

认购佣金=1.00×1,000×0.80%=8.00元

认购金额=1.00×1,000×（1+0.80%）=1,008.00元

净认购金额=1.00×1,000=1,000.00元
即，若该投资者通过发售代理机构采用网上现金方式认购本基金份额1,000份，则需缴纳认购金额1,008.00元。

（2）网下现金认购

通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购金额的计算公式为：

1）认购费用适用比例费率时：

认购费用=认购价格×认购份额×认购费率

认购金额=认购价格×认购份额×（1+认购费率）

利息折算的份额=利息/认购价格

2）认购费用适用固定费用时：

认购费用=固定费用

认购金额=认购价格×认购份额+固定费用

利息折算的份额=利息/认购价格

认购费用由基金管理人收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。利息折算基金份额保留整数位，小数部分舍去归基金资产。

例：某投资者通过基金管理人采用网下现金方式认购本基金100,000份，假定认购金额产生的利息为10元，则该投资者的认购金额及募集期间利息折算的份额为：

认购费用=1.00×100,000×0.80%=800.00元

认购金额=1.00×100,000×（1+0.80%）=100,800.00元

又设该资金在募集期间产生了10元的利息，则

利息折算的份额=10/1.00=10份（保留至整数位）

即，若该投资者通过基金管理人采用网下现金方式认购本基金100,000份，则需缴纳认购金额100,800元，并可获得利息转换的份额10份，获得100,010份本基金份额。

通过发售代理机构进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金和认购金额的计算同通过发售代理机构进行网上现金认购的计算。

4、认购限制

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍。投资者可以多次认购，除本公告中募集规模上限规定外，累计认购份额不设上限。

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在5万份以上（含5万份）。投资人可以多次认购，除本公告中募集规模上限规定外，累计认购份额不设上限。

5、募集期间的资金与费用

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

三、投资者开户

投资者认购本基金时需具有证券账户，证券账户是指深圳A股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户。

（一）如投资人需新开立证券账户，则应注意：

1、如投资者需要参与网下现金或网上现金认购，应使用深圳A股账户或深圳证券交易所基金账户；深圳证券交易所基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。

（二）账户使用注意事项

已购买过由平安基金管理有限公司担任登记结算机构的基金的投资者，其拥有的平安基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

四、网上现金认购的程序

（一）业务办理时间：2023年12月18日至2023年12月22日上午9:30—11:30和下午1:00—3:00。

（二）认购手续：投资者直接通过发售代理机构办理认购。

1、开立深圳A股账户或深圳证券交易所基金账户。
2、在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。
3、投资者可通过填写认购委托单、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托，可多次申报，申报一经确认，认购资金即被冻结。

五、网下现金认购的程序

（一）直销机构

1、业务办理时间：2023年12月18日至2023年12月22日，9:30—10:00。

2、投资者须先开立深圳A股账户或深圳证券交易所基金账户，然后向本公司直销网点提供下列资料办理基金的认购手续：

（1）个人投资者：

1）ETF基金业务交易申请表（填妥并签字或盖章）

2）本人有效身份证件签字复印件

3）证券账户开户确认单复印件

4）签署《个人投资者风险承受能力调查表》

（2）机构投资者：

1）ETF基金业务交易申请表（填妥并盖章）

2）证券账户开户确认单复印件（盖章）

3）经办人有效身份证件复印件（盖章）

4）营业执照复印件（盖章）

5）基金业务授权委托书（填妥并盖章）

6）签署《机构投资者风险承受能力调查表》

3、在认购当日16:30之前，将足额认购资金汇入本公司指定的任一直销专户：

1）户名：平安基金管理有限公司直销清算账户

账号：0122500000624

大额支付号：307584021120

开户银行：平安银行深圳分行桂园支行

2）户名：平安基金管理有限公司（销售账户）

账号：767963010571

大额支付号：104584001493

开户行：中国农业银行深圳蛇口网谷支行

3）户名：平安基金管理有限公司

账号：44201503500059188168

大额支付号：10584000407

开户银行：中国建设银行深圳分行福田支行

4）户名：平安基金管理有限公司销售账户

账号：41-005000040018488

大额支付号：103584000507

开户银行：中国农业银行深圳分行中心区支行

5）户名：平安基金管理有限公司（客户）

账号：443066450018010046284

大额支付号：301584000467

开户银行：交通银行深圳分行学府支行

6）户名：平安基金管理有限公司销售账户

账号：4000020829200412316

大额支付号：102584002081

开户银行：中国工商银行深圳分行八卦岭支行

7）户名：平安基金管理有限公司销售账户

账号：755918093810802

大额支付号：308584001303

开户银行：招商银行股份有限公司深圳湾支行

8）户名：平安基金管理有限公司销售专户

账号：337010100101234454

大额支付号：309584005014

开户银行：兴业银行深圳分行营业部

以上八个账户均可进行资金的划入，银行账户名称填写完整，包括括号和括号里的全部内容。
投资者若未按上述办法办理认购款项，造成认购无效的，平安基金管理有限公司及直销专户的开户银行不承担任何责任。

（1）投资者在银行填写划款凭证时，请写明用途。

（2）投资者当日提交申请并在当日规定时间内认购资金到账，方可视为有效申请；如果投资者认购资金当日未到账，实际资金到账之日提交的申请可视为有效申请；如果投资者认购资金当日到账，但是晚于规定时间，则当日提交的申请可顺延到下一个工作日受理。

4、以下情况将被视为无效认购，款项将退往投资者指定的资金结算账户：

（1）投资者已缴款，但未办理开户手续或开户不成功的；

（2）投资者已缴款，但未办理认购申请或认购申请未被确认的；

（3）投资者缴款金额少于其申请的认购金额；

（4）投资者缴款时间晚于基金认购结束日本公司规定时间的；

（5）其它导致认购无效的情况。

（二）发售代理机构

1、认购时间：2023年12月18日至2023年12月22日，9:30至16:

平安基金管理有限公司关于平安中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告

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合同全文及招募说明书全文于2023年12月6日在本公司网站（www.fund.pingan.com）和中国证监会基金信息披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）披露，供投资者查阅。

如有疑问可拨打本基金管理人全国统一客户服务热线400—800—4800（免长途话费）及直销专线电话0755—22627627咨询相关事宜。

30、具体业务办理时间由发售代理机构确定。

2、认购手续：投资者直接通过发售代理机构办理认购。