

**平安大华中证沪港深高股息精选指数型  
证券投资基金招募说明书更新摘要  
(2018年第1期)**

**基金管理人：平安大华基金管理有限公司**

**基金托管人：平安银行股份有限公司**

**二零一八年一月**

## 重要提示

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2016年8月29日证监许可[2016]1978号文注册。本基金的基金合同于2017年1月25日正式生效。

基金管理人保证本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。

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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险、本基金的特定风险等。

本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

本基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本基金名称仅表明基金可以通过港股通机制投资港股，本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，基金资产对港股标的投资比例会根据指数调整等发生调整，存在不对港股进行投资的可能。

本基金可投资中小企业私募债券，当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降等，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影

响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。本基金是指数基金，其特定风险包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险，标的指数波动的风险，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；并且，指数的历史业绩不代表未来表现。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑投资者自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。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，由投资者自行承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

本招募说明书（2018年第1期）所载内容截止日期为2018年1月24日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为2017年12月31日。有关财务数据未经审计。

本基金托管人平安银行股份有限公司于2018年2月6日对本招募说明书（2018年第1期）进行了复核。

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

#### 1、基本情况

名称：平安大华基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

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

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会 证监许可【2010】1917 号

法定代表人：罗春风

成立日期：2011 年 1 月 7 日

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币 30000 万元

存续期间：持续经营

联系人：吴小红

联系电话：0755-22623879

#### 2、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	18,210	60.7%
大华资产管理有限公司	7,500	25%
三亚盈湾旅业有限公司	4,290	14.3%
合计	30,000	100%

基金管理人无任何重大行政处罚记录。

3、客服电话：400-800-4800（免长途话费）

## 二、基金管理人主要人员情况

### 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、平安大华基金管理有限公司副总经理、平安大华基金管理有限公司总经理。现任平安大华基金管理有限公司董事长兼任深圳平安大华汇通财富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. Michalski Inc.（美国）养老金咨询分析员、Guardian Life Ins. Co（美国）助理精算师、Swiss Re（美国）精算师、Deloitte Actuarial Consulting Ltd.（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、平安大华基金管理有限公司督察长。现任平安大华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，任大华银行有限公司董事总经理，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，同时于香港上市公司“数码通电讯集团有限公司”任独立非执行董事。

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官，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。

李兆良先生，独立董事，博士，1965年生。曾任招商局蛇口工业区华南液化气船务公司远洋三副、二副、后加入中国平安保险（集团）任总公司办公室法律室主任、总公司办公室主任助理、高级法律顾问、兼任中国平安保险（集团）总公司保险业务管理委员会委员、总公司投资审查委员会委员、广东海信现代律师事务所专职律师、合伙人；现任广东华瀚律师事务所任主任律师、合伙人。

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；现任彩日本料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；现任平安大华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，现任平安大华基金管理有限公司监察稽核岗。

### （3）公司高管

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、平安大华基金管理有限公司副总经理、平安大华基金管理有限公司总经理，现任平安大华基金管理有限公司董事长兼任深圳平安大华汇通财富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、平安大华基金管理有限公司督察长；现任平安大华基金管理有限公司总经理。

付强先生，博士，高级经济师，1969年生。曾任中国华润总公司进出口副科长、申银万国证券研究所任高级研究员、申万巴黎基金管理公司高级研究经理、安信证券首席分析师、嘉实基金管理公司产品总监、平安证券有限责任公司副总经理。现任平安大华基金管理有限公司副总经理。

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。现任平安大华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。现任平安大华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。现任平安大华基金管理有限公司督察长。

## 2、基金经理

施旭先生，哥伦比亚大学金融数学硕士，曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券，于2015年加入平安大华基金，任衍生品投资中心量化研究员，现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金（2016-05-19至今）、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金（2016-11-02至今）、平安大华鑫享混合型证券投资基金（2016-12-27至今）、平安大华鑫安混合型证券投资基金（2016-12-27至今）、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金（2017-01-25至今）、平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金（2017-05-17至今）、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金（2017-05-11至今）、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金（2017-11-01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：副总经理林婉文女士，投资执行总经理孙健先生，基金经理神爱前先生。

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。现任平安大华基金管理有限公司副总经理。

孙健先生，投资研究部执行总经理，基金经理，硕士。曾任湘财证券有限责任公司资产管理总部投资经理，中国太平人寿保险有限公司投资部、太平资产管理有限公司组合投资经理，摩根士丹利华鑫货币市场基金基金经理，银华基金管理有限公司固定收益部副总监，银华货币市场基金基金经理、银华信用债券型基金基金经理。2011年9月加入平安大华基金公司，任投资研究部固定收益研究员，现担任“平安大华保本混合型证券投资基金”、“平安大华安心保本混合型证券投资基金”、“平安大华安享保本混合证券投资基金”、“平安大华安盈保本混合型证券投资基金”基金经理。

神爱前先生，厦门大学财政学硕士，7年证券从业经验，曾任第一创业证券研究所行业研究员、民生证券研究所高级研究员、第一创业证券资产管理部高级研究员，2014年12月加入平安大华基金管理公司，任投资研究部高级研究员，现任平安大华策略先锋混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人职责

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、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度、半年度和年度基金报告；

11、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；

12、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；

13、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；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15、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；

16、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；

17、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前提下得到有关资料的复印件；

18、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；

19、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；

20、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；

21、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；

22、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；

23、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；

24、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；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、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》（以下简称“《证券法》”）的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《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，并建立健全的内部控制制度，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）利用基金财产或职务便利为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；

（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、规章及行业规范，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) 故意损害基金持有人或其它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；

(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；

(8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其它股票投资；

(9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；

(10) 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；

(11) 贬损同行，以提高自己；

(12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(13) 以不正当手段谋求业务发展；

(14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(15) 其它法律、行政法规禁止的行为。

4、基金管理人关于禁止行为的承诺

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；
- (8) 法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

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其他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的原则，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。

## 五、基金经理承诺

- 1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着敬业、诚信和谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- 2、不协助、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，不利用职务之便为自己、或任何第三者谋取利益；
- 3、不违反现行有效的法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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；
- 4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 六、基金管理人的内部风险控制制度

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

- 1、公司内部控制的总体目标
  - (1) 保证公司经营管理活动的合法合规性；
  - (2) 保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；

- (3) 实现公司稳健、持续发展，维护股东权益；
- (4) 促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责；
- (5) 保护公司最重要的资本：公司声誉。

## 2、公司内部控制遵循的原则

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位职员；

(2) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(3) 相互制约原则：公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡；

(4) 独立性原则：公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位；公司内部部门和岗位的设置必须权责分明；

(5) 有效性原则：各种内部管理制度具有高度的权威性，应是所有员工严格遵守的行动指南；执行内部管理制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

(6) 适时性原则：内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

(7) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，力争以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果；

(8) 防火墙原则：公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离。

## 3、内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的纲要和总揽；第二个层面是公司基本管理制度，包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案制度、业绩评估考核制度和紧急应变制

度；第三个层面是部门业务规章，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；第四个层面是业务操作手册，是各项具体业务和管理工作的运行办法，是对业务各个细节、流程进行的描述和约束。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

#### 4、关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

##### （1）授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

##### （2）公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

##### （3）基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

##### （4）交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；应建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；集中交易室应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时应建立科学的投资交易绩效评价体系。

#### （5）基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

#### （6）信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

#### （7）监察稽核

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。



## 5、基金管理人关于内部控制制度声明书

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

成立日期：1987 年 12 月 22 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：17,170,411,366 元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037 号

联系人：高希泉

联系电话：(0755) 2219 7701

#### 1、平安银行基本情况

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行，证券代码 000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司，于 2012 年 6 月吸收合并原平安银行并于同年 7 月更名为平安银行。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行 58% 的股份，为平安银行的控股股东。截至 2017 年 6 月末，在职员工 31721 人，通过全国 64 家分行、1081 家营业机构为客户提供多种金融服务。

截至 2017 年上半年，平安银行收入、利润、规模保持稳健发展。营业收入 540.73 亿元、准备前营业利润 401.84 亿元（同比增长 11.14%）、净利润 125.54 亿元（同

比增长 2.13%)、资产总额 30,921.42 亿元（较上年末增长 4.70%）、吸收存款余额 19,123.33 亿元、发放贷款和垫款总额（含贴现）15,942.81 亿元（较上年末增幅 8.03%）。

平安银行总行设资产托管事业部，下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、资金清算处、规划发展处、IT 系统支持处、督察合规处、基金服务中心 8 个处室，目前部门人员为 60 人。

## 2、主要人员情况

陈正涛,男,中共党员,经济学硕士、高级经济师、高级理财规划师、国际注册私人银行家,具备《中国证券业执业证书》。长期从事商业银行工作,具有本外币资金清算,银行经营管理及基金托管业务的经营管理经验。1985年7月至1993年2月在武汉金融高等专科学校任教;1993年3月至1993年7月在招商银行武汉分行任客户经理;1993年8月至1999年2月在招行武汉分行武昌支行任计划信贷部经理、行长助理;1999年3月—2000年1月在招行武汉分行青山支行任行长助理;2000年2月至2001年7月在招行武汉分行公司银行部任副总经理;2001年8月至2003年2月在招行武汉分行解放公园支行任行长;2003年3月至2005年4月在招行武汉分行机构业务部任总经理;2005年5月至2007年6月在招行武汉分行硚口支行任行长;2007年7月至2008年1月在招行武汉分行同业银行部任总经理;自2008年2月加盟平安银行先后任公司业务部总经理助理、产品及交易银行部副总经理,一直负责公司银行产品开发与管理,全面掌握银行产品包括托管业务产品的运作、营销和管理,尤其是对商业银行有关的各项监管政策比较熟悉。2011年12月任平安银行资产托管部副总经理;2013年5月起任平安银行资产托管事业部副总裁(主持工作);2015年3月5日起任平安银行资产托管事业部总裁。

## 3、基金托管业务经营情况

2008年8月15日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。

截至2017年9月底,平安银行股份有限公司托管净值规模合计6.17万亿,托管证券投资基金共110只,具体包括华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、

华富量子生命力股票型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、招商保证金快线货币市场基金、平安大华日增利货币市场基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金、平安大华财富宝货币市场基金、红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华活期添利货币市场证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、鹏华安盈宝货币市场基金、平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、嘉合磐石混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金、鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金、博时裕泰纯债债券型证券投资基金、德邦增利货币市场基金、中海顺鑫保本混合型证券投资基金、民生加银新收益债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金、博时裕景纯债债券型证券投资基金、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、嘉实稳丰债券型证券投资基金、嘉实稳盛债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、华润元大现金通货币市场基金、平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金、南方荣欢定期开放混合型发起式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中海合嘉增强收益债券型证券投资基金、鹏华丰安债券型证券投资基金、富兰克林国海新活力灵活配置混合型证券投资基金、南方颐元债券型发起式证券投资基金、鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金、鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金、西部利得天添利货币市场基金、鹏华弘腾灵活配置混合型证券投资基金、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠享纯债债券型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、广发沪港

深新起点股票型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、博时丰达纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠利纯债债券型证券投资基金、广发鑫盛18个月定期开放混合型证券投资基金、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金、鹏华丰盈债券型证券投资基金、平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、平安大华金管家货币市场基金、平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金、博时泰安债券型证券投资基金、新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金、国联安睿智定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、前海开源聚财宝货币市场基金、招商招弘纯债债券型证券投资基金、招商稳阳定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金、前海开源沪港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、西部利得汇享债券型证券投资基金、鹏华丰玉债券型证券投资基金、华安睿安定期开放混合型证券投资基金、西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金、广发汇安18个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金、南方和元债券型证券投资基金、长盛盛通纯债债券型证券投资基金、平安大华添益债券型证券投资基金、平安大华惠元纯债债券型证券投资基金、中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金、兴银消费新趋势灵活配置混合型证券投资基金、南方高元债券型发起式证券投资基金、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金、中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金、中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、南方智造未来股票型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、嘉实稳悦纯债债券型证券投资基金。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，平安银行股份有限公司严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管要求，自觉形成守法经营、规范运作的经营理念和经营风格；确保基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益；确保内部控制和风险管理体系的有效性；防范和化解经营风险，确保业务的安全、稳健运行，促进经营目标的实现。

### 2、内部控制组织结构

平安银行股份有限公司设有总行独立一级部门资产托管事业部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理工作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

资产托管事业部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；取得基金从业资格的人员符合监管要求；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 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

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用行业普遍使用的“资产托管业务系统——监控子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金

投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## 2、监督流程

(1) 每工作日按时通过监控子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的投资指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

(4) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、销售机构

##### （1）直销机构

平安大华基金管理有限公司

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

直销电话：0755-22627627

直销传真：0755-23990088

联系人：尹延君

网址：[www.fund.pingan.com](http://www.fund.pingan.com)

##### （2）代销机构

#### (1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

联系人：李鸿岩

联系电话：010-66107913

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

#### (2) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

联系人：陈洪源

联系电话：010-66592194



客服电话：95566

传真：010-66594465

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(3) 平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系人：赵杨

联系电话：0755-22166574

客服电话：95511-3

传真：021-50979507

网址：<http://bank.pingan.com/>

(4) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：任巧超

联系电话：0574-81850830

客服电话：95574

传真：0574-87050024

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

(5) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：朱雅葳

联系电话：021-38676666

客服电话：95521

传真：021-38670666

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(6) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

联系电话：010-85156398

客服电话：400-8888-108

传真：010-65182261

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(7) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人：何如

联系人：周杨

联系电话：0755-82130833

客服电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(8) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

客服电话：400-8888-888/95551

传真：010-83574807

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(9) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼

办公地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 40 楼

法定代表人：李梅

联系人：李玉婷

联系电话：021-33388229

客服电话：95523 或 4008895523

传真：021-33388224

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(10) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

联系电话：021-38565547

客服电话：95562

传真：0591-38507538

网址：[www.xyzq.com](http://www.xyzq.com)

(11) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

联系电话：021-68751860

客服电话：95579 或 4008-888-999

传真：027-85481900

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(12) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

电话：0755-82555551

客服电话：400-800-1001

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(13) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

联系人：张煜

电话：023-63786633

客服电话：95355、400-8096-096

传真：023-63786212

网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

(14) 万联证券有限责任公司

注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 E 座 12 层

法定代表人：张建军

联系人：甘蕾

电话：020-38286026

传真：020-38286588

客服电话：400-8888-133

网址：[www.wlzq.cn](http://www.wlzq.cn)

(15) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：王星

电话：022-28451922

网址：[www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

(16) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

客服电话：95597

传真：0755-82492962（深圳）

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(17) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081493

客服电话：95321

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(18) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：何耀

联系电话：021-22169999

客服电话：95525

传真：021-22169134

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(19) 东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市自由大路 1138 号

办公地址：吉林省长春市自由大路 1138 号

法定代表人：杨树财

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

客服电话：95360

传真：0431-85096795

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(20) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：王芬

电话：021-53686888

传真：021-53686100，021-53686200

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

(21) 大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

电话：0351-4130322

传真：0351-7219891

网址：[www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

(22) 国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街8号7-9层

法定代表人：姚志勇

联系人：沈刚

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

客服电话：95570

网址：[www.gpsc.com.cn](http://www.gpsc.com.cn)

(23) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：刘世安

联系人：石静武

联系电话：0755-22631117

客服电话：400-8816-168

传真：0755-82400862

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(24) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座D座

办公地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座D座

法定代表人：庞介民

联系人：魏巍

电话：0471-3953168

传真：0471-3979545

客服电话：400-196-6188

网址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

(25) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人：李季

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客服电话：4008000562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(26) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经十路20518号

办公地址：山东省济南市经七路86号证券大厦

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

联系电话：021-20315117

客服电话：95538

传真：0531-68889752

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

(27) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦15-20楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

电话：0755-23838750

传真：0755-25838701

客服电话：95358

网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

(28) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路291号



办公地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：杜航

联系人：史江蕊

联系电话：010-64818301

传真：010-64818443

客服电话：95335

网址：[www.scstock.com](http://www.scstock.com)

(29) 华林证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道 1-1 号君泰国际 B 栋一层 3 号

办公地址：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 6 楼

法定代表人：林立

联系人：刘志坚

电话：0755-82707888

传真：0755-82707700

客服电话：400-188-3888

网址：[www.chinalions.com](http://www.chinalions.com)

(30) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

联系人：刘熠

电话：021-68761616

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

(31) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街甲 6 号 SK 大厦

法定代表人：毕建明

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

客服电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com.cn

(32) 华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼

办公地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼

邮政编码：200120

法定代表人：郭林

联系人：陈媛

电话：021-38784818-8502

传真：021-68774818

客服电话：400-820-5999

网址：www.shhxzq.com

(33) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10楼

法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

电话：0755-83331195

客服电话：95564

网址：www.lxzq.com.cn

(34) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街95号

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

电话：028-86690057、028-86690058

客服电话：95310

公司网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

(35) 开源证券股份有限公司

注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人：李刚

联系人：黄芳

电话：029-63387256

传真：029-81887060

客服电话：400-860-8866

网址：[www.kysec.cn](http://www.kysec.cn)

(36) 深圳新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

电话：010-83363099

传真：010-83363010

客服电话：400-166-1188

网址：<http://8.jrj.com.cn>

(37) 苏州财路基金销售有限公司

注册地址：苏州工业园区华池街88号1幢1003室

办公地址：苏州市姑苏区苏站路1599号7号楼1101室

法定代表人：高志华

联系人：张君

电话：0512-68603767,18516765123

网站：[www.cai6.com](http://www.cai6.com)

客服电话：0512-68603767

(38) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

联系电话：021-80359115

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

客服电话：400-821-5399

(39) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：0755-33227950

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

客服电话：4006-788-887

(40) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服电话：400-1818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(41) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(42) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

电话：021-60897840

传真：0571-26697013

客服电话：400-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(43) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

联系人：徐鹏

电话：86-021-50583533

传真：86-021-50583533

客服电话：400-067-6266

网址：<http://admin.leadfund.com>

(44) 乾道金融信息服务(北京)有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室

法定代表人：王兴吉

联系人：高雪超

网址：[www.qiandaojr.com](http://www.qiandaojr.com)

电话：400888080

(45) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：钱燕飞

联系人：赵耶

客服电话：95177

网址：[www.snjjin.com](http://www.snjjin.com)

(46) 北京格上富信投资顾问有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

法定代表人：李悦章

联系人：曹庆展

联系电话：010-85932450

网址：[www.igesafe.com](http://www.igesafe.com)

客服电话：400-066-8586

(47) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层

法定代表人：李悦

联系人：张晔

电话：010-58845312

网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

客服电话：400-8980-618

(48) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：010-56282140

客服电话：400-619-9059

网址：<http://www.fundzone.cn>

(49) 深圳盈信基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1

办公地址：辽宁省大连市中山区南山路 155 号南山 1910 小区 A3-1

法定代表人：苗宏升

网站：[www.fundying.com](http://www.fundying.com)

客服电话：4007-903-688

(50) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21&28 层

法定代表人：蒋煜

联系人：殷雯

电话：010-58170844

传真：010-58170710

网址：[www.shengshiview.com.cn](http://www.shengshiview.com.cn)

客服电话：400-818-8866

(51) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：刘栋栋

电话：010-88312877

传真：010-88312099

客服电话：400-001-1566

网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(52) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

法定代表人：赵荣春

联系人：盛海娟

电话：010-57418813

传真：010-57569671

网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

客服电话：400-893-6885

(53) 扬州国信嘉利投资理财有限公司

注册地址：广陵产业园创业路 7 号

办公地址：江苏省扬州市文昌西路 56 号公元国际 320

法定代表人：王浩

网址：[www.gxjlc.com](http://www.gxjlc.com)

客服电话：400-021-6088

(54) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：张晓辉

网址：[www.taichengcaifu.com](http://www.taichengcaifu.com)

客服电话：400-6411-999

(55) 北京微动利投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341 室

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341 室

法定代表人：梁洪军

联系人：季长军



电话：010-52609656

传真：010-51957430

网址：<http://www.buyforyou.com.cn/>

客服电话：400-819-6665

(56) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话：021-65370077

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

(57) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室

办公地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室

法定代表人：董浩

联系人：牛亚楠

联系电话：18610807009

客服电话：400-068-1176

网址：[www.jimubox.com](http://www.jimubox.com)

(58) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期418室

法定代表人：齐小贺

联系人：刘昊

电话：0755-83999907

传真: 0755-83999926

客服电话: 0755-83999907

网址: [www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

(59) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址: 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号

办公地址: 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号

法定代表人: 陶捷

联系人: 孔繁

电话: 027-87006009

网址: <http://www.buyfunds.cn>

客服电话: 400-027-9899

(60) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人: 郭坚

联系人: 宁博宇

电话: 021-20665952

传真: 021-22066653

客服电话: 4008219031

网址: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(61) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址: 南京市建邺市江东中路 359 号

办公地址: 上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人: 袁顾明

联系人: 何庭宇

电话: 13917225742

传真：021-22268089

客服电话：021-22267995/400-928-2266

网址：[www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

(62) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸城大厦1115、1116及1307室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：项晶晶

电话：0755-8946 0500

传真：0755-2167 4453

客服电话：400-684-0500

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(63) 深圳市金斧子投资咨询有限公司

注册地址：深圳市南山区智慧广场第A栋11层1101-02

办公地址：深圳市南山区科苑路18号东方科技大厦18楼

法定代表人：陈姚坚

联系人：陈姿儒

网址：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

电话：4009500888

(64) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人：钟斐斐

客服电话：400-061-8518

网址：<https://danjuanapp.com>

(65) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A

法人代表：高锋

联系人：廖苑兰

联系电话：0755-83655588

网址：[www.keynesasset.com](http://www.keynesasset.com)

客服电话：400-804-8688

（66）深圳信诚基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 210 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区时代财富大厦第 49A 单元

法定代表人：周文

联系人：杨涛

客服电话：0755-23946579

网址：[www.ecpefund.com](http://www.ecpefund.com)

（67）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

法定代表人：俞洋

电话：021-64339000

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

邮政编码：200030

联系人：杨莉娟

传真电话：021-54967293

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

华鑫证券公司网站：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

（68）南京证券股份有限公司

注册地址：南京市玄武区大钟亭 8 号

办公地址：南京市江东中路 389 号

法定代表人：步国旬

联系人：王万君

电话：025-58519523

客服电话：95386

网址：www.njzq.cn

2、基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构，并及时公告。

## 二、基金登记机构

平安大华基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

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：0755-22624581

传真：0755-23990088

联系人：张平

## 三、律师事务所和经办律师

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：021-3135 8666

传真：021-3135 8600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

## 四、会计师事务所和经办注册会计师

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 号企业天地 2 号普华永道中心 11 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

联系电话：（021）2323 8888

传真电话：（021）2323 8800

经办注册会计师：曹翠丽、边晓红

联系人：边晓红

## 第四部分 基金的名称

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

## 第五部分 基金的类型

股票型证券投资基金

## 第六部分 基金的运作方式

契约性开放式

## 第七部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证沪港深高股息精选指数。在正常市场情况下，力争将基金的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控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

### 二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。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）、港股通标的股票、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、中小企业私募债券、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。

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。

基金的投资组合比例为：

本基金90%以上的基金资产投资于股票。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%，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%。

本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

如果法律法规或中国证监会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。

### 三、投资策略



本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期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，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 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，本基金将主要投资于标的指数成份股和备选成份股。原则上本基金将采用指数复制法，按标的指数的成份股权重构建组合。特殊情况下，本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。

#### （二）股票投资策略

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。

##### 1、股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。特殊情况下，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

##### 2、股票投资组合的调整

###### （1）定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

## （2）不定期调整

1) 当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；

2) 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

3) 特殊情况下，如基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

上述特殊情况包括但不限于以下情形：①法律法规的限制；②标的指数成份股长期停牌；③标的指数成份股流动性严重不足；④成份股上市公司存在重大违规行为，有可能面临重大的处罚或诉讼。

## （三）债券投资策略

债券投资策略方面，本基金在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境分析方面，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定不同类属资产的最优权重。

在微观市场定价分析方面，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

## （四）权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

## （五）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;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### （六）资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。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。

#### （七）中小企业私募债券投资策略

本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制,通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制,严格控制风险,对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估,并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响,通过信用研究和流动性管理后,决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

## 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 90%以上的基金资产投资于股票；
- （2）本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；
- （3）本基金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,应当

保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（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%；

（14）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；

（15）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的

10%；

（16）基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（17）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议或其他基金管理人和基金托管人书面协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

（18）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（11）项以外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

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有关约定。期间，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。

如果法律法规对基金合同约定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，则本基金投资不再受相关限制，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 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）向基金管理人、基金托管人出资；
- （5）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；
- （6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

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

制人或者与其有其他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的原则，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。

## 五、标的指数和业绩比较基准

1、本基金的标的指数：中证沪港深高股息精选指数，及其未来可能发生的变更。

中证沪港深高股息精选指数从沪深 A 股以及符合港股通条件的港股中选取 100 只流动性好、连续分红、股息率高、盈利持续且具有成长性的股票作为指数样本股，采用股息率加权，以反映沪港深三地市场股息率高、盈利持续且具有成长性的股票的整体表现。

如果指数编制单位变更或停止中证沪港深高股息精选指数的编制、发布或授权，或中证沪港深高股息精选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中证沪港深高股息精选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，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，变更本基金的标的指数。若标的指数变更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，报中国证监会备案并在指定媒介公告。若标的指数变更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机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，在报中国证监会备案后及时公告。

2、本基金业绩比较基准：

中证沪港深高股息精选指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%

本基金选择该业绩基准，是基于以下因素：

1.中证沪港深高股息精选指数由中证指数有限公司发布，反映了沪港深三地市场股息率高、盈利持续且具有成长性的股票的整体表现。

2.活期存款利率由中国人民银行公布，具有广大的知名度和市场影响力；

3.本基金的各投资标的的比例，选用该业绩比较基准能够真实反映本基金的风险收益特征。

若本基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更。若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更而由此引起的业绩比较基准的变更，则基金管理人应就变更标的指数及业绩比较基准召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案并在指定媒介公告。若标的指数变更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机构变更、指数更名等）而由此引起的业绩比较基准的变更，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。

## 六、风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

## 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1、有利于基金资产的安全与增值；

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

3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益；

4、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。

## 八、基金的转型

若将来基金管理人推出以中证沪港深高股息精选指数为标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），本基金由基金管理人和基金托管人协商一致后可相应调整为该交易型开放式指数基金（ETF）的联接基金模式并对投资运作等相关内容进行调整，

届时无需召开基金份额持有人大会，但需报中国证监会变更注册或备案并提前公告。

联接基金是指其绝大部分基金资产投资于同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），以紧密跟踪标的指数为目的的指数化产品。法律法规另有规定的从其规定。

## 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。

基金托管人平安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2017年12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	18,569,263.11	93.46
	其中：股票	18,569,263.11	93.46
2	基金投资	-	-
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	1,288,211.16	6.48
8	其他资产	12,140.12	0.06
9	合计	19,869,614.39	100.00

### 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 1.2.1 报告期末指数投资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	-	-
B	采矿业	-	-



C	制造业	4,564,888.70	23.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	92,160.00	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	223,668.00	1.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	100,100.00	0.51
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,980,816.70	25.33

### 1.2.2 报告期末积极投资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	-	-
B	采掘业	210,330.00	1.07
C	制造业	3,685,602.20	18.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	401,349.00	2.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,037,202.00	5.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	230,509.00	1.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	66,877.18	0.34

R	文化、体育和娱乐业	43,043.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	5,674,912.38	28.86

### 1.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	353,276.46	1.80
B 消费者非必需品	3,845,367.38	19.55
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	677,120.53	3.44
F 医疗保健	434,549.48	2.21
G 工业	504,881.28	2.57
H 信息技术	1,182,850.26	6.02
I 电信服务	-	-
J 公用事业	667,415.63	3.39
K 房地产	248,073.01	1.26
合计	7,913,534.03	40.24

### 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

#### 1.3.1 报告期末指数投资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	600660	福耀玻璃	32,600	945,400.00	4.81
2	000895	双汇发展	32,300	855,950.00	4.35
3	00868	信义玻璃	92,000	782,879.87	3.98
4	01999	敏华控股	82,400	511,770.85	2.60
5	00425	敏实集团	12,000	472,957.88	2.41
6	02020	安踏体育	14,000	414,862.13	2.11
7	02018	瑞声科技	3,500	407,840.49	2.07
8	02313	申洲国际	6,000	373,150.22	1.90
9	600563	法拉电子	7,100	360,751.00	1.83
10	002294	信立泰	7,800	352,482.00	1.79

#### 1.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	00303	VTECH HOLDINGS	6,100	522,142.82	2.66
2	601877	正泰电器	19,500	509,925.00	2.59
3	02333	长城汽车	58,500	437,661.58	2.23
4	600023	浙能电力	75,300	401,349.00	2.04
5	00002	中电控股	5,800	387,619.83	1.97

#### 1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

本基金本报告期末无债券投资。

#### 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

本基金本报告期末无资产支持证券投资情况。

#### 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

本基金本报告期末无贵金属投资。

#### 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

本基金本报告期末无权证投资情况。

#### 1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资情况。

##### 1.9.2 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。

#### 1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

**1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无国债期货投资。

**1.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末无国债期货投资。

**1.11 投资组合报告附注****1.11.1**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

**1.11.2**

基金投资的前十名股票没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**1.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	11,874.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	266.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,140.12

**1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****1.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### **1.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### **1.11.6 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。

## 第八部分 基金的业绩

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。

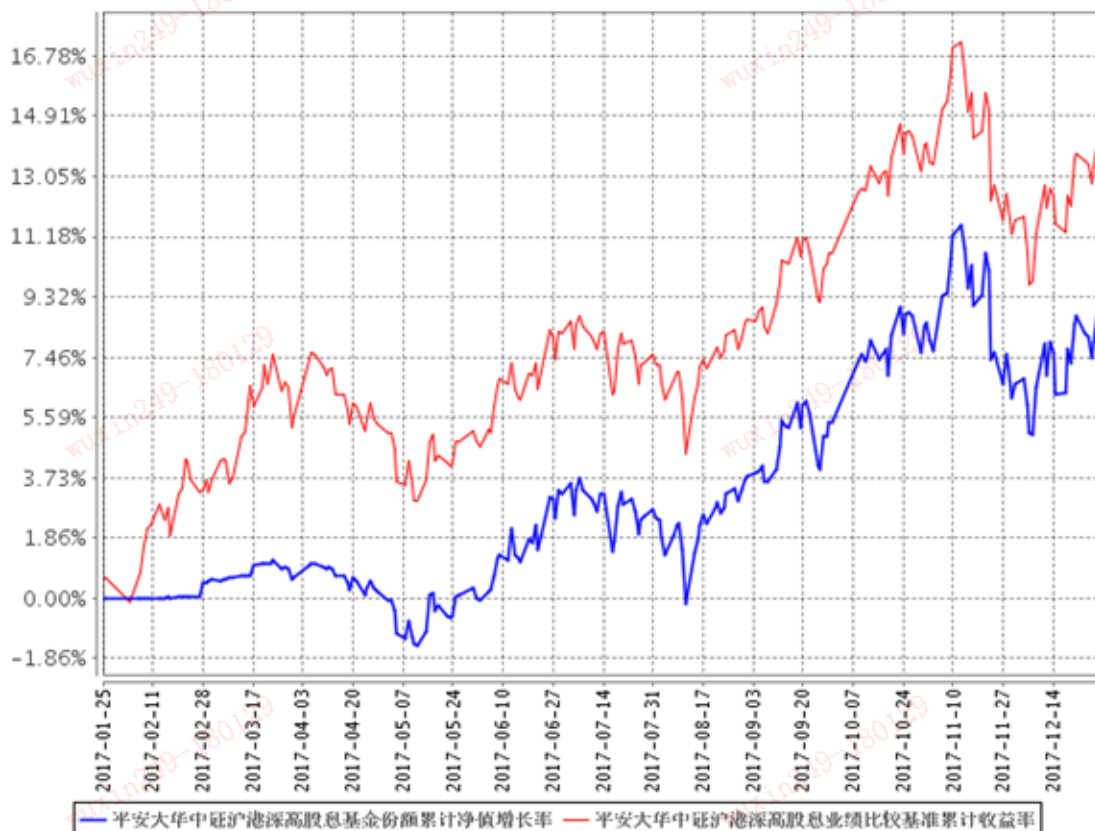
一、自基金合同生效以来（2017年1月25日）至2017年12月31日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段	份额净值增长率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
2017.1.25-2017.6.30	3.20%	0.33%	8.19%	0.56%	-4.99%	-0.23%
2017.7.1-2017.12.31	5.28%	0.70%	5.34%	0.68%	-0.06%	0.02%
自基金合同生效至今	8.65%	0.56%	13.97%	0.63%	-5.32%	-0.07%

业绩比较基准：中证沪港深高股息精选指数收益率\*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份额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

平安大华中证沪港深高股息基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于2017年1月25日正式生效，截至报告期末已满一年；

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。

## 第九部分 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、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用许可费；
- 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、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、基金的开户费用、账户维护费用；
- 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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算



方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

### 3、指数使用许可费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法从基金财产中支付指数使用许可费。指数使用许可费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H为每日计提的指数使用许可费

E为前一日的资产净值

自基金成立的下一季度（自然季度）起，指数使用许可费收取下限为每季度（自然季度）5万元，即不足5万元时按照5万元收取。基金成立日所在季度，若按规模计提的指数使用许可费超过5万元，则按实际天数计提；若按规模计提的指数使用许可费不足5万元，则：

$$\text{当季指数使用许可费} = 50,000 \text{元} \times \text{基金当季存续天数} \div \text{当季天数}$$

指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季度支付。基金管理人应于每个季度（自然季度）结束后10个工作日内与标的指数许可方结算该季度的指数使用费。

如果指数使用许可协议约定的指数使用许可费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

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。

## 第十部分 其他应披露事项

（一）本基金管理人、基金托管人目前无重大诉讼事项。

（二）最近半年本基金管理人、基金托管人及高级管理人员没有受到任何处罚。

（三）2017年7月25日至2018年1月24日发布的公告：

1、2017年8月1日，平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券认购、申购、定投申购费率优惠活动的公告；

2、2017年8月24日，关于平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2017年8月23日（非港股通交易日）暂停申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务的公告；

3、2017年8月25日，平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券申购、定投申购费率优惠活动的公告；

4、2017年8月28日，平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2017年半年度报告以及摘要；

5、2017年9月7日，平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金招募说明书更新（2017年第1期）以及摘要；

6、2017年9月18日，平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳前海欧中联合基金销售有限公司为销售机构并开通定投及转换业务和参与费率优惠的公告；

7、2017年10月25日，平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2017年第三季度报告；

8、2017年12月25日，关于旗下部分基金新增华鑫证券为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告；

9、2017年12月25日，平安大华基金管理有限公司关于调整旗下基金持有流通受限股票估值方法的公告；

10、2017年12月30日，平安大华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金缴纳增值税的公告；

11、2018年1月4日，关于平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基

金 2018 非港股通交易日暂停申购、赎回、转换、定投业务的公告；

12、2018年1月12日，关于旗下部分基金新增南京证券为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告；

13、2018年1月19日，平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告；

## 第十一部分 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》等相关法律法规的要求及基金合同的规定，对2017年9月7日公布的《平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金招募说明书(更新)2017年第1期》进行了更新，主要更新的内容如下：

- 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“三、基金管理人”部分。
- 3、根据最新资料，更新了“四、基金托管人”部分。
- 4、根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”部分。
- 5、“九、基金的投资”中，根据最新资料，更新了“九、投资组合报告”的内容。
- 6、根据最新资料，更新了“十、基金的业绩”的内容。
- 7、根据最新资料，更新了“十七、风险揭示”的内容。
- 8、在“二十二、其他应披露的事项”部分，更新了2017年7月25日至2018年1月24日期间涉及本基金的公告。
- 9、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”。

平安大华基金管理有限公司  
2018年2月12日