

**平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型  
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：中国银行股份有限公司

二零一八年三月

## 重要提示

平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2016年8月2日证监许可[2016]1749号文注册。本基金基金合同于2016年9月20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。

本基金封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例为 0%-100%；债券资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；开放期内或按照《基金合同》的约定，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内或转型为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除国债期货和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投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

在本基金封闭期内，基金份额持有人只能通过证券市场二级市场交易卖出基金份额变现。在证券市场持续下跌、基金二级市场交易不活跃等情形下，有可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响基金份额持有人收益或产生损失。

在本基金封闭期内，本基金灵活运用大类资产配置、定向增发股票、债券投资策略等多种投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。本基金可投资定向增发股票，公募基金参与定向增发，如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，将按照监管机构或行业协会有关规定确定股票公允价值，本基金基金净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值，投资者在二级市场交易或受限申购赎回时，需考虑该估值方式对基金净值的影响。

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。

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3月19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。

本基金托管人中国银行股份有限公司于2018年4月7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%

基金管理人无任何受重大行政处罚记录。

#### 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) 养老金咨询分析师、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。1994年起参加工作，曾任深圳发展银行支行行长、深圳分行信贷管理部、授信审批部总经理、平安银行总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

刘俊廷，硕士研究生，曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。现任平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2016-07-21 至今)、平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金(2016-09-20 至今)、平安大华鼎弘混合型证券投资基金(2017-04-26 至今)、平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017-09-06 至今)、平安大华鼎沣定期开放灵活配置混合型证券投资基金(2017-06-20 至 2018 年 3 月 21 日止)、平安大华安盈保本混合型证券投资基金(2018-03-07 至今)基金经理。

WANG AO 先生，CAIA、FRM，CFA，澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士，曾任职原深发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012年9月加入平安大华基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益研究员。现任平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金(2016-07-21 至今)、平安大华鑫享混合型证券投资基金(2016-9-5 至今)、平安大华惠金债券型证券投资基金(2016-11-2 至今)、平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金(2016-12-7 至今)、平安大华惠裕债券型证券投资基金(2017-3-10 至今)、平安大华添利债券型证券投资基金(2017-12-1 至今)、平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金(2018-3-16 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，衍生品投资中心投资执行总经理 DANIEL DONGNING SUN 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。

DANIEL DONGNING SUN 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月加入平安大华基金管理有限公司，任衍生品投资中心投资执行总经理。现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金、平安大华沪深300指数量化增强证券投资基金、平安大华鑫荣混合型证券投资基金、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安大华股息精选沪港深股票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、中国证监会和《基金合同》规定的其它义务。

#### 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) 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;
- (7) 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。

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

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) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### (二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### (三) 证券投资基金托管情况

截至2017年12月31日，中国银行已托管650只证券投资基金，其中境内基金613只，QDII基金37只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### (四) 托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### **（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序**

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、场外发售机构

##### (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：陈四清

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)

#### (2) 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：易会满

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)

(3) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

联系人：卞晁煜

电话：021-52629999-218022

客服电话：95561

传真：021-62569070/62569187

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

(4) 民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

电话：010-58560666

客服电话：95568

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

(5) 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/>

(6) 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.nbc.com.cn

(7) 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：钟伟镇

联系电话：021-38032284

客服电话：95521

传真：021-38670666

网址：www.gtja.com

(8) 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：刘畅

联系电话：010-65608231

客服电话：400-8888-108

传真：010-65182261

网址：www.csc108.com

(9) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：郑慧

联系电话：010-60838888

客服电话：95548

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(10) 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)

(11) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

联系人：李笑鸣

联系电话：021-23219275

客服电话：95553

传真：021-23219100

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

(12) 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)

(13) 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)

(14) 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)

(15) 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)

(16) 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

(17) 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

(18) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：姜晓林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：0532-96577

传真：0532-85022605

网址：www.citicssd.com

(19) 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)

(20) 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、李芳芳

联系电话: 021-22169999

客服电话: 95525

传真: 021-22169134

网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.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) 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: 周一涵

联系电话: 021-38637436

客服电话: 400-8816-168

传真: 0755-82400862

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

(23) 东海证券股份有限公司

注册地址: 江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

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

(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：熊丽

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：韩志谦

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105

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

(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

(28) 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：毕明建

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

客服电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com.cn

(29) 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

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

联系人：杨莉娟

业务联系电话：021-54967552

传真电话：021-54967293

网站：www.cfsc.com.cn

客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

(30) 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

(31) 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.gjq.com.cn

(32) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

联系人：岑妹妹

电话：027-87617017

客服电话：95391/400-800-5000

网址：<http://www.tfzq.com>

(33) 首创证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

法定代表人：毕劲松

联系人：刑飞

电话：010-59366004

网址：www.sczq.com.cn

(34) 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：袁伟涛

电话：029-63387289

传真：029-81887060

客服电话：400-860-8866

网址：www.kysec.cn

(35) 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

(36) 上海云湾投资管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

法定代表人：戴新装

联系人：江辉

电话：021-20530224

传真：021-20538999

客服电话：400-820-1515

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

(37) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层  
1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层  
1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

电话：010-6083 3754

传真：010-5776 2999

客服电话：400-990-8826

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

传真：010-5776 2999

客服电话：400-990-8826

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

(38) 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>

(39) 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)

(40) 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)

(41) 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>

(42) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人：罗细安

联系人：李皓

联系电话：13521165454

客服电话：400-001-8811

传真：010-67000988-6000

网址：www.zcvc.com.cn

(43) 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

(44) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区金钟路 658 弄 2 号楼 B 座 6 楼

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电话：021-52822063-8301

传真：021-62990063

客服电话：4000-466-788

网址：www.66zichan.com

(45) 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

(46) 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

(47) 上海陆金所基金销售有限公司

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

(48) 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

(49) 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、场内发售机构

场内销售机构：深圳证券交易所内具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位，具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的相关公告。

3、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

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：周明

联系电话：010-59378835

传真：010-59378839

联系人：朱立元

## 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）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

平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金

## 第五部分、 基金的类型

混合型

## 第六部分、 基金的运作方式

契约开放型,本基金的封闭期为基金合同生效之日(包括基金合同生效之日)至 20 个月(含 20 个月)后的对应日的前一日止(若该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一工作日)。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起至 20 个月后的对应日前一日的期间,以此类推。本基金自封闭期结束之后的第一个工作日起(包括该日)进入开放期,本基金每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日,具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。

## 第七部分 基金的投资

### 一、投资目标

在严格控制风险的前提下，灵活运用大类资产配置、定向增发股票、债券投资策略等多种投资策略，充分挖掘市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。按《基金合同》约定，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，充分挖掘市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、衍生工具（权证、股指期货、国债期货等）、债券资产（包括国债、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、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等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）、现金资产等货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须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。

封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例为 0%-100%；债券资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；开放期内或按照《基金合同》的约定，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内或转型为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除国债期货和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投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金参与股指期货、国债期货交易，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

(一) 本基金通过对宏观经济、行业分析轮动效应与定向增发项目优势的深入研究的基础上，灵活运用大类资产配置策略、定向增发股票、债券投资策略等多种投资策略，充分挖掘市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。

#### 1、大类资产配置策略

本基金通过对宏观经济因素、政策因素、盈利因素、估值因素、流动性和行为因素六个方面的综合分析，严谨衡量不同类别资产的预期风险/收益特征，评估各个市场的相对投资价格，合理确定基金在股票、债券、现金、衍生工具等各类资产类别上的投资比例，并在基金合同投资范围约定的范围下适时进行动态调整。

#### 2、定向增发股票投资策略

定向增发是指上市公司向符合条件的特定投资者(包括大股东、机构投资者、自然人等)非公开发行业股票的融资方式。本基金将对进行非公开发行的上市公司从估值水平以及成长性两个角度出发进行基本面分析，结合市场未来走势进行判断，从战略角度评估参与定向增发的预期中签情况、预期损益和风险水平。充分考虑定向增发的一二级价差，并在严格掌控投资组合风险与收益的前提下，积极参与其定向增发项目。在定向增发股票锁定期结束后，本基金将根据对股票内在投资价值和成长性的判断，结合股票市场环境的分析，选择适当的时机卖出。

本基金采用股票定量和定性分析方法，从估值水平和发展前景两个角度，通过财务和运营数据分析市场现有定向增发项目。本基金主要从行业景气度、盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行考量，主要指标包括：各行业公司的估值指标(如 PE、PB、PE/G、PS、股息率等)、成长性指标(主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率等)、现金流量指标和其他财务指标。从中选出价值相对低估、成长性确定、现金流量状况好、盈利能力和偿债能力强的公司，作为备选定向增发股票。

在定量分析的基础上,本基金通过分析备选定向增发项目所对应的公司的业务环节的竞争优势和劣势,分析定向增发项目对公司未来的影响。主要考虑因素包括:

1) 在技术能力方面,选择研发团队技术实力强、技术的发展与应用前景广阔并且在技术上具有一定护城河的公司。

2) 在市场前景方面,需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强度以及上市公司利用科技创新能力取得竞争优势、进而开拓市场的能力。

3) 在公司治理结构方面,将从上市公司的管理层评价、战略定位和管理制度体系等方面进行评价,通过定量分析和定性分析,最终确定股票投资组合,并适时进行投资组合调整。

按照定向增发的对象、资金用途,区分为以下几种主要模式:

#### (1) 大股东主导的定向增发投资

大股东主导的定向增发项目包括集团公司整体上市、实际控制人资产注入、发行对象包含大股东或者大股东关联方的公司间资产置换重组,以及融资收购大股东资产的几种定向增发项目。

#### (2) 项目融资类定向增发投资

项目融资类的定向增发项目为定向增发项目中最常见的类别,目前市场上近一半的定向增发项目为项目融资类。

#### (3) 非大股东方参与资产重组的定向增发投资

通过定向增发项目实现资产重组是企业与其他主体对企业资产的分布状态进行重新组合、调整、配置或对企业资产上的权利进行重新配置的过程。重组前后公司的估值往往会有明显的改变。

#### (4) 融资收购非大股东方资产的定向增发投资

对于融资收购非大股东方资产的定向增发项目,长期来看,公司能够通过定向增发项目中收归的资产实现企业基本面指标的优化,通过上下游产业并购、合并同业竞争对手或跨行业并购实现公司主营业务的拓展,减少公司运营成本或大幅提升市场占有率来重组企业现有资源,提升经营业绩。重组前后公司的估值往往会有明显的改变。

本基金将深入研究不同类别的定向增发项目在不同期限内对公司基本面的

影响,对定向增发项目可能带来的影响进行模拟分析,挑选具有绝对或相对估值吸引力的公司股票,再通过分析和评估股权变化,结合预期盈利水平和成长潜力,择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资,尽可能获取定向增发项目给投资者带来的超额收益。

### 3、债券投资策略

本基金在综合考虑宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的基础上,采取至上而下和结合的投资策略积极选择和配置债券资产。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。

### 4、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。

### 5、衍生品投资策略

1) 本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。投资原则为有于基金资产增值,控制下跌风险实现保和锁定收益。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

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。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立衍生品投资决策部门或小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

## 2) 国债期货投资策略

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。

本基金通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。具体而言，本基金的国债期货投资策略包括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。

本基金在运用国债期货投资控制风险的基础上，将审慎地获取相应的超额收益，通过国债期货对债券的多头替代和稳健资产仓位的增加，以及国债期货与债券的多空比例调整，获取组合的稳定收益。

基金管理人针对国债期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。此外，基金管理人建立国债期货交易决策部门或小组，并授权特定的管理人员负责国债期货的投资审批事项。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

## 6、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。

#### 7、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。

(二) 按照《基金合同》约定，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，充分挖掘市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。

#### 1、大类资产配置策略

为有效实施投资策略，本基金将在资产配置允许的范围内，采取相对灵活的资产配置策略。

本基金将从宏观环境、政策因素、资金供求因素、证券市场基本面等角度进行综合分析，判断各类资产的市场趋势和预期风险收益，在严格控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等大类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。

#### 2、股票投资策略

本基金采用股票定量和定性分析方法，从估值水平和发展前景两个角度分析。定量分析方法主要通过财务和运营数据分析，主要指标包括：各行业公司的估值指标（如 PE、PB、PE/G、PS、股息率等）、成长性指标（主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率等）、现金流量指标和其他财务指标。从中选出价值相对低估、成长性确定、现金流量状况好、盈利能力和偿债能力强的公司。

定性分析是指在特定的市场阶段，灵活运用 GARP 分析、主题轮动、定向增发、安全边际投资等多种投资策略，并采用深度价值挖掘和多层面立体投资分析体系，多层面地分析备选股票所对应公司业务环节的竞争优势和劣势，分析公司治理和公司管理方面的优势和劣势，行业历史及行业变革力量。

通过定量分析和定性分析，最终确定股票投资组合，并适时进行投资组合调整。

### (1) GARP 分析策略

GARP (Growth at Reasonable Price) 策略实现的是股票的价值与成长的平衡。一方面利用股票的成长属性分享高成长收益机会；另一方面，利用价值型投资标准筛选低估值股票，有效控制市场波动时的风险。

本基金将重点关注以下几类成长性股票：

**传统成长 (Classic growth)：** 优先挑选具有持续、稳定的业绩增长历史，且预期盈利能力将保持增长的公司。

**新兴成长 (Rising growth)：** 对于部分处于成长阶段没有盈利的行业，优先考虑营业收入能够保持增长、且成本控制基本合理的公司。

**周期成长 (Cyclical growth)：** 对于周期类公司，优先考虑市场份额能够保持增长的公司。

**并购成长 (Merging growth)：** 适当考虑并购和重组类机会。

在运用 GARP 选股策略时，重点关注①**成长速度：** 重点选择营业收入和营业利润在行业中未来将保持相对领先增长速度的公司。②**成长空间：** 通过分析公司所处的行业前景，行业集中度和在行业中的地位，选择服务和产品未来具备广阔成长空间的公司。③**成长模式：** 通过对公司的竞争壁垒、内部管理能力、行业属性等进行定性分析，选择业绩增长具有合理基础，在未来能够持续的公司。④**成长估值：** 重点关注 PEG<1 或低于行业平均水平的公司。

### (2) 主题轮动策略

主题轮动策略是基于自上而下的投资主题分析框架，综合运用定量和定性的分析方法，并综合考虑国家宏观政策，挖掘市场的长期性和阶段性主题投资机会，并从中发现与投资主题相符的行业和具有核心竞争力的上市公司，力争获取市场超额收益。

本基金通过对经济发展过程中的制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘潜在的投资主题。在主题投资的基础上，将综合考虑主题的产生原因、发展阶段、市场容量以及估值水平等因素，确定每个主题的配置权重范围，并选择那些受惠于投资主题的公司进行投资。

### (3) 定向增发投资策略

本基金采用股票定量和定性分析方法，从估值水平和发展前景两个角度，通

过财务和运营数据分析市场现有定向增发项目。本基金主要从行业景气度、盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行考量，从中选出价值相对低估、成长性确定、现金流量状况好、盈利能力和偿债能力强的公司，作为备选定向增发股票。

在定量分析的基础上，本基金通过分析备选定向增发项目所对应的公司的业务环节的竞争优势和劣势，分析定向增发项目对公司未来的影响。

#### (4) 安全边际投资策略

本基金通过挖掘相对价值被低估、具有较安全边际的价值型股票，实现资本的长期增值。重点关注在相关行业具有核心竞争优势，以及由于政策垄断和较高进入壁垒带来持续发展能力的个股，通过比较公司内在价值和股票价格之间的差价，当两者差价超过某一安全边际时即对该股票进行投资。

根据市场有效性原理，当某一种投资策略受到投资者的过度追捧时运用该种策略进行投资的有效性就会相对下降。为了避免或减少单一投资策略在不同市场情形下的适应性弊端，本基金通过多维度“策略雷达”对每种投资策略在当前情况下进行适应性评估，捕捉各种投资策略中具备比较价值优势的股票，以此为基础构建本基金的股票投资组合。

### 3、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。

### 4、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。

## 5、衍生品投资策略

(1) 本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。投资原则为有益于基金资产增值,控制下跌风险实现保和锁定收益。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

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。

基金管理人将在进行股指期货投资前将建立衍生品投资决策部门或小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。

### (2) 国债期货投资策略

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。

本基金通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断,并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置,谨慎进行投资,以调整债券组合的久期,降低投资组合的整体风险。具体而言,本基金的国债期货投资策略包括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。

本基金在运用国债期货投资控制风险的基础上,将审慎地获取相应的超额收益,通过国债期货对债券的多头替代和稳健资产仓位的增加,以及国债期货与债券的多空比例调整,获取组合的稳定收益。

基金管理人针对国债期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程,确

保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。此外，基金管理人建立国债期货交易决策部门或小组，并授权特定的管理人员负责国债期货的投资审批事项。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

#### 6、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。

#### 7、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。

### 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) 本基金的投资组合比例为：封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例为 0%-100%；债券资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；开放期内或按照《基金合同》的约定，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；

(2) 在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内或转换为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴

纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%;

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5) 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%;

(6) 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%;

(7) 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%;

(8) 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%;

(9)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%;

(10) 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%;

(11) 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%;

(12) 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;

(13) 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;

(14) 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,债券回购到期后不展期;

(15) 本基金投资流通受限证券,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;

(16) 如本基金投资股指期货的,遵循以下中国证监会规定的投资限制:

1) 本基金在任何交易日日终,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%;

2) 本基金在封闭期内,任何交易日日终,持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券之和,不得超过基金资产净值的 100%;开放期内或转换为上市开放式基金(LOF)后,在任何交易日日终,持有的买入国债期货和股指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 95%;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、资产支持证券等;

3) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;

4) 本基金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;

5) 本基金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%;

(17) 如本基金投资国债期货的,遵循以下中国证监会规定的投资限制:

1) 本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的 15%;

2) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

3) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债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 30%;

4) 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(18) 在封闭期内,本基金投资中小企业私募债券的剩余期限,不得超过本基金的剩余封闭运作期;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%;

(19) 本基金在封闭期内,基金总资产不得超过基金净资产的 200%,开放期或转换为上市开放式基金(LOF)后,基金总资产不得超过基金净资产的 140%;



(20) 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。

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上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

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、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是：

沪深300指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

业绩比较基准选择理由：沪深300指数选样科学客观，流动性高，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中债综合指数具广泛市场代表性，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。基于本基金的特征，使用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人与基金托管人协商一致，可以变更业绩比较基准，在履行适当程序后报中国证监会备案，并在中国证监会指定媒介及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

## 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、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	138,310,240.94	18.64
	其中:股票	138,310,240.94	18.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	589,712,617.10	79.46
	其中:债券	589,712,617.10	79.46
	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	2,442,699.96	0.33
8	其他资产	11,707,319.47	1.58
9	合计	742,172,877.47	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	73,092,262.81	11.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,897,318.63	2.67
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	22,307,688.96	3.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,337,395.61	0.53
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	22,675,574.93	3.58
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	138,310,240.94	21.84

### 1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	002344	海宁皮城	3,151,574	22,675,574.93	3.58
2	600676	交运股份	3,496,503	22,307,688.96	3.52
3	002073	软控股份	2,367,985	18,351,883.50	2.90
4	000875	吉电股份	4,464,285	16,897,318.63	2.67
5	600522	中天科技	1,039,501	13,695,425.42	2.16
6	002157	正邦科技	2,459,016	13,487,702.76	2.13
7	600531	豫光金铅	1,328,040	8,326,810.80	1.31
8	000901	航天科技	348,476	7,858,133.80	1.24
9	300421	力星股份	322,690	6,055,277.85	0.96
10	002516	旷达科技	1,052,877	5,317,028.68	0.84

### 1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,601,350.40	1.36
	其中：政策性金融债	8,601,350.40	1.36
4	企业债券	130,713,266.70	20.64
5	企业短期融资券	400,182,000.00	63.18
6	中期票据	50,216,000.00	7.93
7	可转债(可交换债)	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	589,712,617.10	93.10

### 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011758043	17 木林森 SCP001	300,000	30,186,000.00	4.77
2	041753008	17 红豆 CP001	300,000	30,132,000.00	4.76
3	011762036	17 三安 SCP004	300,000	30,015,000.00	4.74
4	011758073	17 永达 SCP004	300,000	29,994,000.00	4.74
5	011760113	17 天业 SCP005	300,000	29,985,000.00	4.73

### 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。

### 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。

### 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。

#### 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情况。

## 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

2017年3月20日豫光金铅玉川冶炼厂阳极泥预处理工序塔酸槽顶部动火作业过程中发生一起爆炸事故，事故共造成3人死亡，直接经济损失300万元。（内容详见公司已发布的临2017-012号、临2017-013号公告）。

公司目前已经收到济源市人民政府《关于河南豫光金铅股份有限公司玉川冶炼厂“3·20”塔酸槽较大爆炸事故调查报告的批复》文件，文件中就公司玉川冶炼厂“3·20”事故原因、事故伤亡、事故责任认定及处理结果等进行了通报。根据济源市人民政府《关于河南豫光金铅股份有限公司玉川冶炼厂“3·20”塔酸槽较大爆炸事故调查报告的批复》的建议，本次事故对13名相关责任人给予相应责任追究，对河南豫光金铅股份有限公司处以99万元罚款。

事故发生后，公司已经进行隐患查处，尤其是对易燃易爆、受限空间、高空作业、检修作业作为重点进行检查落实。本基金管理人认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 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	7,116.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,700,202.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,707,319.47

**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**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002344	海宁皮城	22,675,574.93	3.58	非公开发行
2	000875	吉电股份	16,897,318.63	2.67	非公开发行
3	600522	中天科技	13,695,425.42	2.16	非公开发行
4	002157	正邦科技	13,487,702.76	2.13	非公开发行
5	600676	交运股份	10,839,162.40	1.71	非公开发行
6	002073	软控股份	8,879,947.50	1.40	非公开发行
7	600531	豫光金铅	4,023,961.20	0.64	非公开发行
8	000901	航天科技	3,787,934.12	0.60	非公开发行
9	300421	力星股份	2,917,117.60	0.46	非公开发行
10	002516	旷达科技	2,569,022.32	0.41	非公开发行

**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（2016年9月20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：

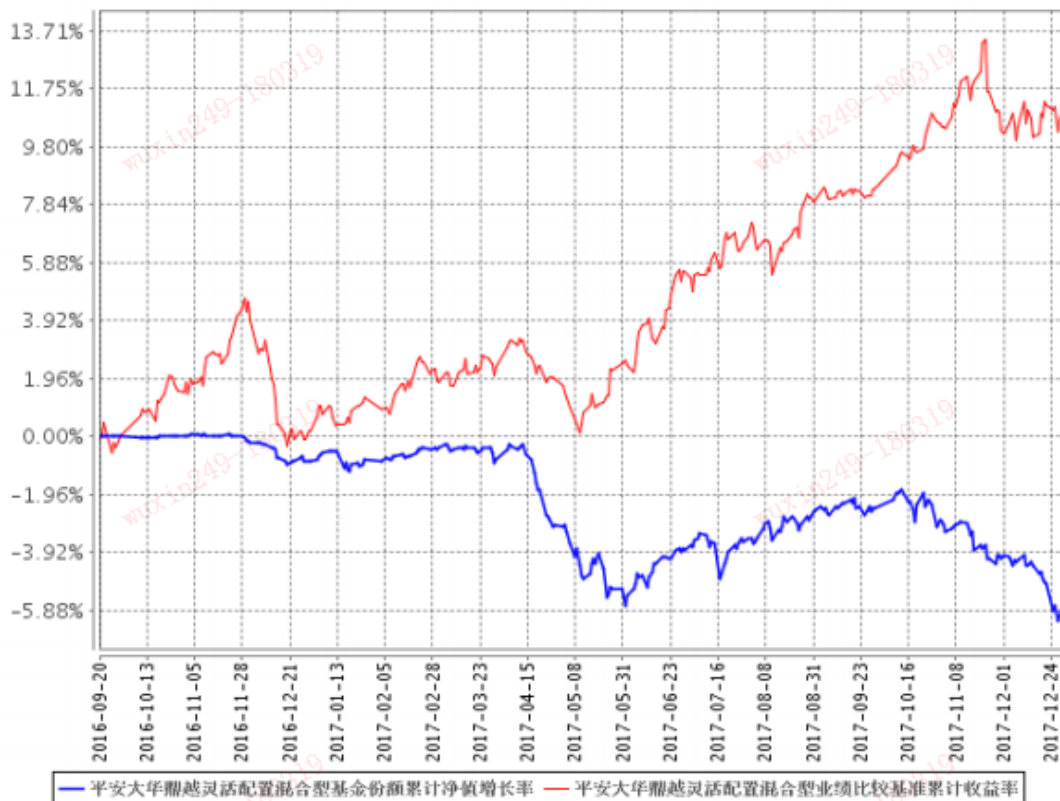
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016.9.20-2016.12.31	-0.81%	0.05%	0.19%	0.38%	-1.00%	-0.33%
2017.1.1-2017.12.31	-5.13%	0.24%	10.65%	0.32%	-15.78%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-5.90%	0.22%	10.85%	0.33%	-16.75%	-0.11%

注：1、业绩比较基准：沪深300指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。沪深300指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场60%左右的市值，是中国A股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映A股市场总体发展趋势。中证综合债券指数是反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行票据及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债、和企业债、该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场标准。根据本基金的投资范围约束，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。



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:

平安大华鼎越灵活配置混合型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 2016 年 9 月 20 日正式生效, 截至报告期已满一年;  
 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。建仓结束时各项资产配置比例符合基金合同的约定。

## 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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《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；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、基金上市费用；
- 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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月第2-5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、休息日等，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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月第 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—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。

### 五、费用的调整

在符合相关法律法规及中国证监会相关规定,及不损害基金份额持有人利益的前提下,基金管理人和基金托管人协商一致并履行相应程序后,可酌情调整基金管理费和基金托管费,此项调整需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

## 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9月20日至2018年3月19日发布的公告：

1、2017年10月25日，平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金2017年第三季度报告；

2、2017年11月1日，平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2017年第2期）以及摘要；

3、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；

4、2017年12月28日，平安大华基金管理有限公司关于旗下基金所持002344(股票代码)估值调整的公告；

5、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；

6、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；

7、2018年1月19日，平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金2017年第4季度报告；

8、2018年2月7日，关于旗下基金所持东山精密（代码:002384）、软控股份（代码:002073）估值调整的公告；

9、2018年3月17日，平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告；

(四) 《招募说明书》与本次更新的招募说明书内容若有不一致之处，以本次更新的招募说明书为准。

## 第十一部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》等其他有关法律法规及基金合同的规定,对2017年11月1日公布的《平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)2017年第2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、“十、基金的投资”中,根据最新资料,更新了“(八)投资组合报告”的内容。
- 6、根据最新资料,更新了“十一、基金的业绩”的内容。
- 7、根据最新资料,更新了“十八、风险揭示”的内容。
- 8、在“第二十三部分、其他应披露的事项”部分,更新了2017年9月20日至2018年3月19日期间涉及本基金的公告。
- 9、根据最新情况,更新了“二十四、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4月18日