

平安大华交易型货币市场基金 招募说明书（更新）摘要

2018 年第 2 期

基金管理人：平安大华基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

截止日期： 2018 年 9 月 22 日

重要提示

平安大华交易型货币市场基金（以下简称“本基金”）根据 2016 年 6 月 22 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予平安大华交易型货币市场基金注册的批复》（证监许可[2016]1380 号）进行募集。本基金的基金合同于 2016 年 9 月 23 日正式生效。

平安大华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为货币市场基金。投资人购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，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的市场风险，因金融市场利率的波动而导致证券市场价格和收益率变动的利率风险或负收益风险，因债券和票据发行主体信用状况恶化而可能产生的到期不能兑付的信用风险，因本产品相关技术、规则、操作等创新性造成基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险。另外，本基金 E 类份额在上海证券交易所上市交易，对于选择通过二级市场交易的投资人而言，其投资收益为买卖价差收益，交易费用和二级市场流动性因素都会在一定程度上影响投资人的投资收益，本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。本基金长期平均风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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。

本招募说明书（2018 年第 2 期）所载内容截止日期为 2018 年 9 月 22 日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为 2018 年 6 月 30 日。有关财务数据未经审计。

本基金托管人国泰君安证券股份有限公司于 2018 年 10 月 16 日对本招募说明书（2018 年第 2 期）进行了复核。

一、 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

法定代表人：罗春风

设立日期：2011 年 1 月 7 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会 证监许可【2010】1917 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币 30000 万元

存续期限：持续经营

联系人：吴小红

联系电话：0755-22623179

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、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。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

申俊华女士，湖南大学金融学博士。曾在中国中投证券有限责任公司担任固定收益研究员。2012 年加入平安大华基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员。现担任平安大华财富宝货币市场基金（2014-09-25 至今）、平安大华交易型货币市场基金（2016-09-23 至今）、平安大华金管家货币市场基金（2016-12-07 至今）、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金（2017-07-14 至今）、平安大华鑫荣混合型证券投资基金（2017-08-23 至今）、平安大华惠悦纯债债券型证券投资基金（2017-09-12 至今）、平安大华日增利货币市场基金（2017-12-05 至今）基金经理。

段玮婧女士，中山大学硕士。曾担任中国中投证券有限责任公司投资经理。2016 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组投资经理。2017 年 1 月起担任平安大华交易型货币市场基金（2017-01-05 至今）、平安大华金管家货币市场基金（2017-01-05 至今）、平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（2018-01-19 至今）、平安大华合瑞定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（2018-03-26 至今）、平安大华合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（2018-04-26 至今）、平安大华短债债券型证券投资基金（2018-05-16 至今）、平安大华合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（2018-06-20 至今）、平安大华合丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（2018-07-16 至今）、平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金（2018-09-26 至今）基金经理。

3、投资决策委员会成员

本公司投资决策委员会成员包括：总经理肖宇鹏先生，权益投资中心投资董事总经理李化松先生，衍生品投资中心投资执行总经理 DANIEL DONGNING SUN 先生、研究中心研究执行总经理张晓泉先生、基金经理黄维先生。

肖宇鹏先生，学士，1970 年生。曾任职于中国证监会系统、平安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。

李化松先生，北京大学经济学硕士，曾先后担任国信证券股份有限公司经

济研究所分析师、华宝兴业基金管理有限公司研究部分析师、嘉实基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理。2018年3月加入平安大华基金管理有限公司，现任平安大华基金权益投资中心投资董事总经理。现担任平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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。

张晓泉先生，清华大学材料科学与工程专业硕士，曾先后担任广发证券股份有限公司研究员、招商基金管理有限公司研究员、国投瑞银基金管理有限公司研究总监助理。2017年10月加入平安大华基金管理有限公司，现任研究中心研究执行总经理。

黄维先生，北京大学微电子学硕士，2010年7月起先后任广发证券股份有限公司研究员、广发证券资产管理（广东）有限公司投资经理，于2016年5月加入平安大华基金管理有限公司，现任平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎弘混合型证券投资基金、平安大华优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、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，各类基金份额的每万份已实现收益和7日年化收益率；

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人提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

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《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (8) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (9) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (10) 贬损同行，以提高自己；
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的行为。

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)、承销证券和投资股票；
- (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。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，在适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制。

5、基金经理承诺

(1)、依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2)、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

(3)、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(4)、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

五、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

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。

2、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。

3、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。

4、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、岗位职责、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。

二、 基金托管人

一、基金托管人概况

（一）基本情况

名称：国泰君安证券股份有限公司

住所：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68号32层

邮政编码：200120

法定代表人：杨德红

成立时间：1999年8月18日

批准设立机关和批准设立文号：证监机构字[1999]77号

组织形式：股份有限公司

注册资本：柒拾陆亿贰仟伍佰万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：证监许可[2014]511号

联系人：王健

联系电话：021-38676666

国泰君安证券前身为国泰证券和君安证券，1999年8月18日两公司合并新设为国泰君安证券股份有限公司。2015年6月26日国泰君安证券在上交所上市交易，证券简称为“国泰君安”，证券代码为“601211”。截至2016年12月31日，国泰君安证券注册资本为76.25亿元人民币，直接设有6家境内子公司和1家境外子公司，并在全国设有31家分公司、368家证券营业部和17家期货营业部，是国内最早开展各类创新业务的券商之一。2008-2016年，公司连续九年在中国证监会证券公司分类评价中被评为A类AA级，为目前证券公司获得的最高评级。

（二）主要人员情况

陈忠义先生，中国国籍，无境外居留权，1970 年 10 月出生，经济学学士，中级经济师，现任国泰君安证券资产托管部总经理。1993 年参加工作，曾任职于君安证券清算部总经理助理、国泰君安证券营运中心副总经理、光大证券营运管理总部总经理等职。“全国金融五一劳动奖章”、“金融服务能手”称号获得者，中国证券业协会托管结算专业委员会副主任委员，带领团队设计的“直通式证券清算质量管理国际化标准平台”，被评为上海市 2011 年度金融创新奖二等奖。2014 年 2 月起任国泰君安证券资产托管部总经理。国泰君安证券总部设资产托管部，现有员工全部具备基金从业资格及本科以上学历，管理人员及业务骨干均具有多年基金、证券和银行的从业经验，从业人员囊括了经济师、会计师、注册会计师、律师、国际注册内部审计师等中高级专业技术职称及专业资格，专业背景覆盖了金融、会计、经济、法律、计算机等各领域，是一支诚实勤勉、积极进取、专业分布合理，职业技能优良的资产托管从业人员队伍。

（三）基金托管业务经营情况

我司获得证券投资基金托管资格以来，广泛开展了公募基金、基金专户、券商资管计划、私募基金等基金托管业务，与建信、华夏、天弘、富国、银华、鹏华、华安、西部利得、长信、中融等多家基金公司及其子公司建立了托管合作关系，截至 2017 年 3 月 22 日托管各类基金 18 只，专业的服务和可靠的运营获得了管理人的一致认可。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

严格遵守国家法律法规、行业规章及公司内相关管理规定，加强内部管理，保证资产托管部业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的监控和管理，确保业务稳健运行，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

国泰君安证券在董事会中内设风险控制委员会，是公司风险管理的最高决策机构；公司在经营管理层面设置风险管理委员会，对公司经营风险实行统筹

管理，对风险管理重大事项进行审议与决策；风险管理部门包括专职履行风险管理职责的风险管理部、合规部、法律部、稽核审计部，以及计划财务部、信息技术部、营运中心等履行其他风险管理职责的部门。

资产托管部设置风控合规岗和稽核监控岗，负责制定本部门风险管理规章制度，分析报告部门整体风险管理状况，评估检查风险管理执行情况并提出改进建议，抓住要害环节和关键风险，协助业务运营岗位进行专项化解，监督风险薄弱环节的整改情况；同时部门设置风险评估及处置小组，由资产托管部总经理及各小组、运营中心负责人组成，负责对重大风险事项进行评估、确定风险管理违规事项的处理意见、突发事件应急管理等事项。

（三）内部控制制度及措施

根据《基金法》、《运作办法》《证券投资基金托管业务管理办法》等法律法规，基金托管人制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《国泰君安证券资产托管业务管理暂行办法》、《国泰君安证券资产托管部内部控制与风险管理操作规程》、《国泰君安证券资产托管部稽核监控操作规程》、《国泰君安证券资产托管部突发事件与危机处理规程》、《国泰君安证券资产托管部保密规程》、《国泰君安证券资产托管部资产保管操作规程》、《国泰君安证券资产托管部档案管理操作规程》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务管理制度化，技术系统完整独立，核心作业区实行封闭管理，业务分工合理，有关信息披露由专人负责。

基金托管人通过基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭式双门禁管理，并配备录音和录像监控系统；建立独立的托管运营系统并进行防火墙设置；实施严格的岗位冲突矩阵管理，重要岗位设置双人复核机制，建立严格有效的操作制约体系；深入进行职业道德教育，树立内控优先的理念，培养部门全体员工的风险防范和保密意识；配备专门的稽核监控岗对基金托管业务运行进行内部稽核审查，以保证基金托管业务内部控制的有效性。

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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、发售主协调人

国泰君安证券股份有限公司

2、销售机构

2.1 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

电话：0755-22627627

传真：0755-23990088

联系人：郑权

网址：www.fund.pingan.com

2.2 代销机构

(1) 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

(2) 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

(3) 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：李颖

联系电话：0755-82133066

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(4) 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

(5) 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

(6)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

(7)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

(8)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

(9) 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

(10) 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

(11) 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

(12) 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

(13)光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 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

(14)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.glsc.com.cn

(15)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

(16) 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

(17) 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

(18) 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

(19)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

(20)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

(21)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

(22)中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：刘毅

客服电话：95532、400-600-8008

传真：0755-82026539

网址：www.china-invs.cn

(23)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>

(24)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

(25) 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

(26) 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

(27) 万和证券股份有限公司

注册地址：海口市南沙路49号通信广场2楼

办公地址：深圳市深南大道7028号时代科技大厦20层西

法定代表人：朱治理

联系人：郭东彤电话：0755-82830333-115

网址：www.wanhesec.com

(3) E类份额场内申赎代理机构

(1) 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

(2) 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：李颖

联系电话：0755-82133066

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(3) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：霍达

联系人：黄婵娟

联系电话：0755-82943666

客服电话：95565；400-8888-111

传真：0755-82943636

网址：www.newone.com.cn

(4) 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

(5) 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

(6) 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

(7) 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

(8) 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

(9) 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

(10) 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

(11) 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

(12) 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

(13) 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

(14) 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

(15) 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

(16) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：高利

联系人：高洋

联系电话：010-59355546

客服电话：95571

传真：010-57398058

网址：www.foundersc.com

(17) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 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

(18) 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：李福春

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

客服电话：95360

传真：0431-85096795

网址：www.nesc.cn

(19) 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：邵珍珍

联系电话：021-53686262

传真：021-53686100，021-53686200

网址：www.962518.com

(20) 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.glsc.com.cn

(21) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7 楼

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7 楼

法定代表人：吴承根

联系人：陈姗

联系电话：021-80108643

客服电话：967777

传真：0571-87902090

网址：www.stocke.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

(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

(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

(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

(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) 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：武晓春

联系人：刘熠

电话：021-68761616

网址：www.tebon.com.cn

(29) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：高涛

联系人：刘毅

客服电话：95532、400-600-8008

传真：0755-82026539

网址：www.china-invs.cn

(30) 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

(31) 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>

2.3 E类基金份额场内销售机构：

场内销售机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、财通证券股份有限公司、长城国瑞证券有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券承销保荐有限公司、长江证券股份有限公司、川财证券有限责任公司、大通证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、德邦证券股份有限公司、第一创业摩根大通证券有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方花旗证券有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、高盛高华证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国开证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、国融证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海际证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华金证券有限责任公司、华林证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有

限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华英证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、金通证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、九州证券股份有限公司、开源证券股份有限公司、联储证券有限责任公司、联讯证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、瑞信方正证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海华信证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券承销保荐有限责任公司、申万宏源证券有限公司、世纪证券有限责任公司、首创证券有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、万和证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、网信证券有限责任公司、五矿证券有限公司、西部证券股份有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中德证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国证券金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中天证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中邮证券有限责任公司、中原证券股份有限公司（排名不分先后，以上交所发布为准）。

3、基金管理人可根据有关法律法规要求，新增其他发售机构并及时公告。

二、基金登记机构

1、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

法定代表人：罗春风

电话：0755-22624581

传真：0755-23990088

联系人：张平

2、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：金颖

联系人：严峰、朱立元

电话：0755-25946013、010-59378839

传真：010-59378907

三、出具法律意见书的律师事务所

律师事务所：广东仁人律师事务所

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 23 楼

负责人：杨少南

电话：0755- 82960158

传真：0755-82960236

经办律师：段善武、陈福平

联系人：段善武

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、陈怡

联系人：陈怡

四、 基金的名称

平安大华交易型货币市场基金

五、 基金的类型

货币市场基金

六、 基金的运作方式

契约型、交易型开放式

七、 基金的投资

一、 投资目标

在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

二、 投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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。

三、 投资策略

本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。

1、 利率策略

本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标、分析宏观经济情况，建立经济前景的情景模拟，进而判断财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时，本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势，对影响资金面的因素进行详细分析与预判，建立资金面的场景模拟。

在宏观分析与流动性分析的基础上，结合历史与经验数据，确定当前资金

的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价等要素，得到当前宏观与流动性条件下的均衡收益率曲线。区分当前利率债收益率曲线期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位，然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线参数变动的程度和概率，确定组合的平均剩余期限，并据此动态调整投资组合。

2、骑乘策略

当市场利率期限结构向上倾斜并且相对较陡时，投资并持有债券一段时间，随着时间推移，债券剩余年限减少，市场同样年限的债券收益率较低，这时将债券按市场价格出售，投资人除了获得债券利息以外，还可以获得资本利得。在多数情况下，这样的骑乘操作策略可以获得比持有到期更高的收益。

3、放大策略

放大策略即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入资金，并购买剩余年限相对较长的债券，以期获取超额收益的操作方式。在回购利率过高、流动性不足、或者市场状况不宜采用放大策略等情况下，本基金将适时降低杠杆投资比例。

4、信用债投资策略

(1) 信用风险控制。本基金拟投资的每支信用债券必需经过平安大华基金债券信用评级系统进行内部评级，符合基金所对应的内部评级规定的方可进行投资，以事前防范和控制信用风险。

(2) 信用利差策略。信用产品相对国债、政策性金融债等利率产品的信用利差是获取较高投资收益的来源。首先，伴随经济周期的波动，在经济周期上行或下行阶段，信用利差通常会缩小或扩大，利差的变动会带来趋势性的信用产品投资机会。同时，研究不同行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定不同行业总体信用风险和利差水平的变动情况，投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业。其次，信用产品发行人资信水平和评级调整的变化会使产品的信用利差扩大或缩小，本基金将充分发挥内部评级在定价方面的作用，选择评级有上调可能的信用债，以获取因利差下降带来的价差收益。第三，对信用利差期限结构进行研究，分析各期限信用债利差水平相对历史平均水平所处的位置，以及不同期限之间利差的相对水平，发现更具投资价值的期限进

行投资；第四，研究分析相同期限但不同信用评级债券的相对利差水平，发现偏离均值较多、相对利差有收窄可能的债券。

(3)类属选择策略。国内信用产品目前正经历着快速发展阶段，不同审批机构批准发行的信用产品在定价、产品价格特性、信用风险方面具有一定差别，本基金将考虑产品定价的合理性、产品主要投资人的需求特征、不同类属产品的持有收益和价差收益特点和实际信用风险状况，进行信用债券的类属选择。

5、资产支持证券投资策略

当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主（包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产），仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。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。

6、其他金融工具投资策略

本基金将密切跟踪银行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品的动向，一旦监管机构允许基金参与此类金融工具的投资，本基金将在届时相应法律法规的框架内，根据对该金融工具的研究，制定符合本基金投资目标的投资策略，在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下，谨慎投资。

四、投资限制

（一）本基金不得投资于以下金融工具：

（1）股票；

（2）可转换债券、可交换债券；

（3）以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外；

（4）信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具；

（5）中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律、行政法规和监管部门取消上述禁止性规定的，在适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制。

（二）投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；

（2）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%；

（3）到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过 30%；

（4）除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过 20%；

（5）同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；

（6）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%；

（7）本基金投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 20%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%。

（8）本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；

（9）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%；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%；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%；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%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）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；

（10）本基金投资的债券与非金融企业债务融资工具的信用评级，不得低于AA+，债券与非金融企业债务融资工具的信用等级应主要参照最近一个会计年度的主体信用评级；

本基金持有债券与非金融企业债务融资工具期间，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20个交易日内予以全部减持。

（11）本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；且本基金投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序；

（12）本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

（13）本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%；

（14）当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%；

（15）当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；

（16）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的10%。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金不符合本条款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（17）在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；在全国银行间债券市场债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

（18）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

（19）中国证监会规定的其他比例限制。

除上述第（1）、（9）、（10）、（16）、（18）项另有约定外，因证券市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、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本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规及监管政策等对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。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上述限制。

（三）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）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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。

法律、行政法规和监管部门取消上述禁止性规定的，在适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制。

五、投资组合平均剩余期限与平均剩余存续期限计算方法

1、计算公式

货币市场基金投资组合平均剩余期限的计算公式为：

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

货币市场基金投资组合平均剩余存续期限的计算公式为：

2、各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定

(1) 银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为 0 天；证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算；

(2) 回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期限为该基础债券的剩余期限，待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；

(3) 银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天

数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算；

（4）中央银行票据的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算；

（5）组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。

（6）对其它金融工具，本基金管理人将基于审慎原则，根据法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法计算其剩余期限。

平均剩余期限的计算结果保留至整数位，小数点后四舍五入。如法律法规或中国证监会对剩余期限计算方法另有规定的从其规定。

六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期七天通知存款税后利率作为本基金的业绩比较基准。

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业绩基准时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

七、风险收益特征

本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

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。

基金托管人国泰君安证券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2018年6月30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	固定收益投资	471,922,352.37	71.79
	其中：债券	461,922,352.37	70.27
	资产支持证券	10,000,000.00	1.52
2	买入返售金融资产	45,045,187.57	6.85
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	134,916,472.83	20.52
4	其他资产	5,456,790.02	0.83
5	合计	657,340,802.79	100.00

1.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	-	5.35
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	115,279,742.36	21.29
	其中：买断式回购融资	-	-

注：本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2018年6月26日	32.12	产品遭遇巨额赎回	10个工作日

2	2018年6月27日	33.51	产品遭遇巨额赎回	10个工作日
3	2018年6月28日	25.47	产品遭遇巨额赎回	10个工作日
4	2018年6月29日	21.29	产品遭遇巨额赎回	10个工作日

1.3 基金投资组合平均剩余期限

1.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	65
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	66
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

1.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	30.46	21.29
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	64.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	3.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	21.83	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	120.39	21.29

1.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

1.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（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	114,993,910.03	21.24
	其中：政策性金融债	114,993,910.03	21.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	60,001,250.91	11.08
6	中期票据	-	-
7	同业存单	286,927,191.43	52.99
8	其他	-	-
9	合计	461,922,352.37	85.31
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

1.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111810238	18 兴业银行 CD238	1,000,000	99,390,703.57	18.36
2	150418	15 农发 18	500,000	49,990,388.28	9.23
3	111806142	18 交通银行 CD142	500,000	49,695,220.88	9.18
4	111898031	18 南京银行 CD079	500,000	49,645,715.66	9.17
5	111892949	18 厦门国际银行 CD028	500,000	48,948,888.69	9.04
6	170207	17 国开 07	350,000	35,000,447.98	6.46
7	170410	17 农发 10	300,000	30,003,073.77	5.54
8	011800349	18 比亚迪 SCP001	200,000	20,000,452.25	3.69
9	011800730	18 海国鑫泰 SCP002	200,000	20,000,441.59	3.69
10	011800938	18 中航租赁 SCP004	200,000	20,000,357.07	3.69

1.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1309%
报告期内偏离度的最低值	0.0108%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0365%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

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十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149086	借呗 49A1	100,000.00	10,000,000.00	1.84

1.9 投资组合报告附注

1.9.1

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

1.9.2

本组合投资的前十名证券的发行主体之一兴业银行，于 2018 年 4 月 19 日被银保监会公开处罚，主要违法违规事实包括：（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。中国银行保险监督管理委员会决定罚款兴业

银行 5870 万元。

本组合投资的前十名证券的发行主体之一南京银行于 2018 年 1 月 9 日被中国银行业监督管理委员会江苏监管局处以行政处罚（苏银监罚决字【2018】1 号），对南京银行镇江分行违规办理票据业务违反审慎经营原则的行为罚款 3230 万元人民币。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，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八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。

1.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,456,789.02
4	应收申购款	1.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,456,790.02

1.9.4 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。

八、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 23 日）至 2018 年 6 月 30 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：

平安大华交易型货币 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净 值收益 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
2016.9.23-2016.9.30	0.0563%	0.0028%	0.0300%	0.0000%	0.0263%	0.0028%
2016.10.1-2016.12.31	0.7030%	0.0015%	0.3450%	0.0000%	0.3580%	0.0015%
2017.01.01-2017.12.31	4.0266%	0.0021%	1.3688%	0.0000%	2.6578%	0.0021%
2018.1.1-2018.6.30	2.1322%	0.0010%	0.6788%	0.0000%	1.4534%	0.0010%
自基金合同生效起至今	7.0519%	0.0022%	2.4225%	0.0000%	4.6294%	0.0022%

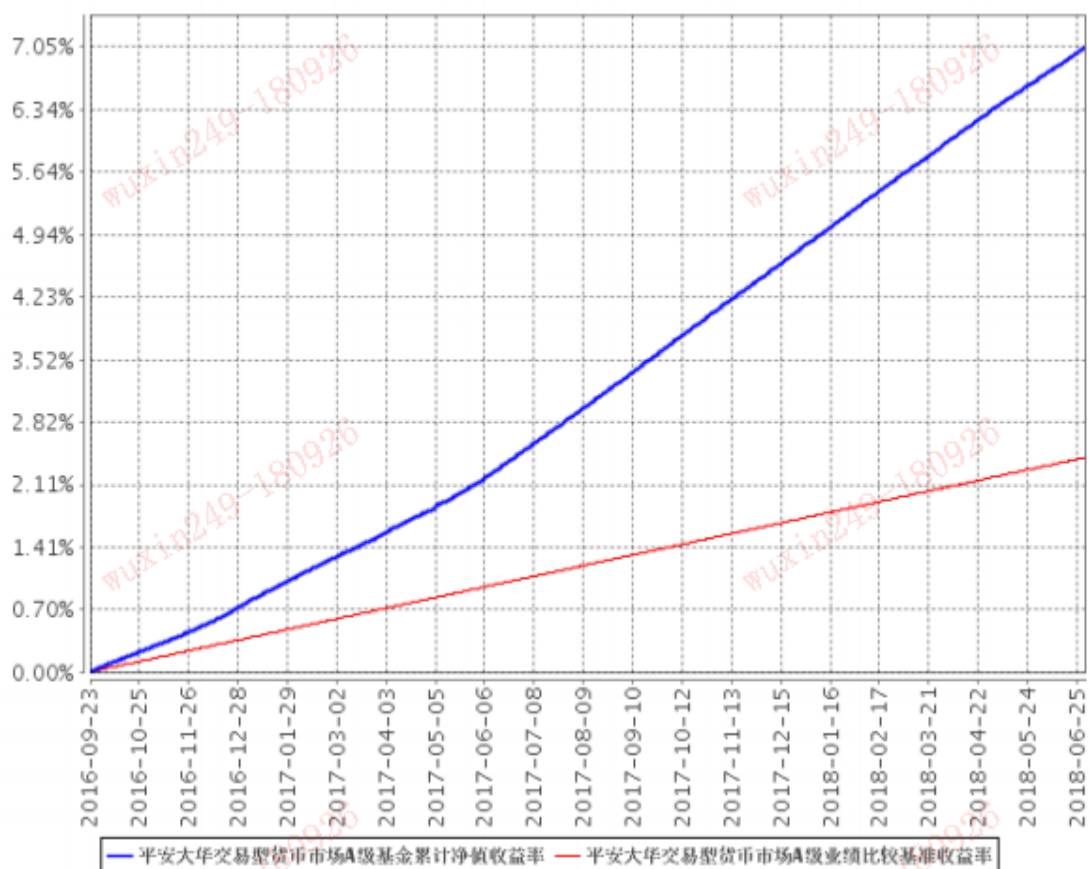
平安大华交易型货币 E

阶段	份额净 值收益 率①	份额净 值收益 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
2016.9.23-2016.9.30	0.0563%	0.0028%	0.0300%	0.0000%	0.0263%	0.0028%
2016.10.1-2016.12.31	0.7030%	0.0015%	0.3450%	0.0000%	0.3580%	0.0015%
2017.01.01-2017.12.31	4.0265%	0.0021%	1.3688%	0.0000%	2.6577%	0.0021%
2018.1.1-2018.6.30	2.1323%	0.0010%	0.6788%	0.0000%	1.4535%	0.0010%
自基金合同生效起至今	7.0519%	0.0022%	2.4225%	0.0000%	4.6294%	0.0022%

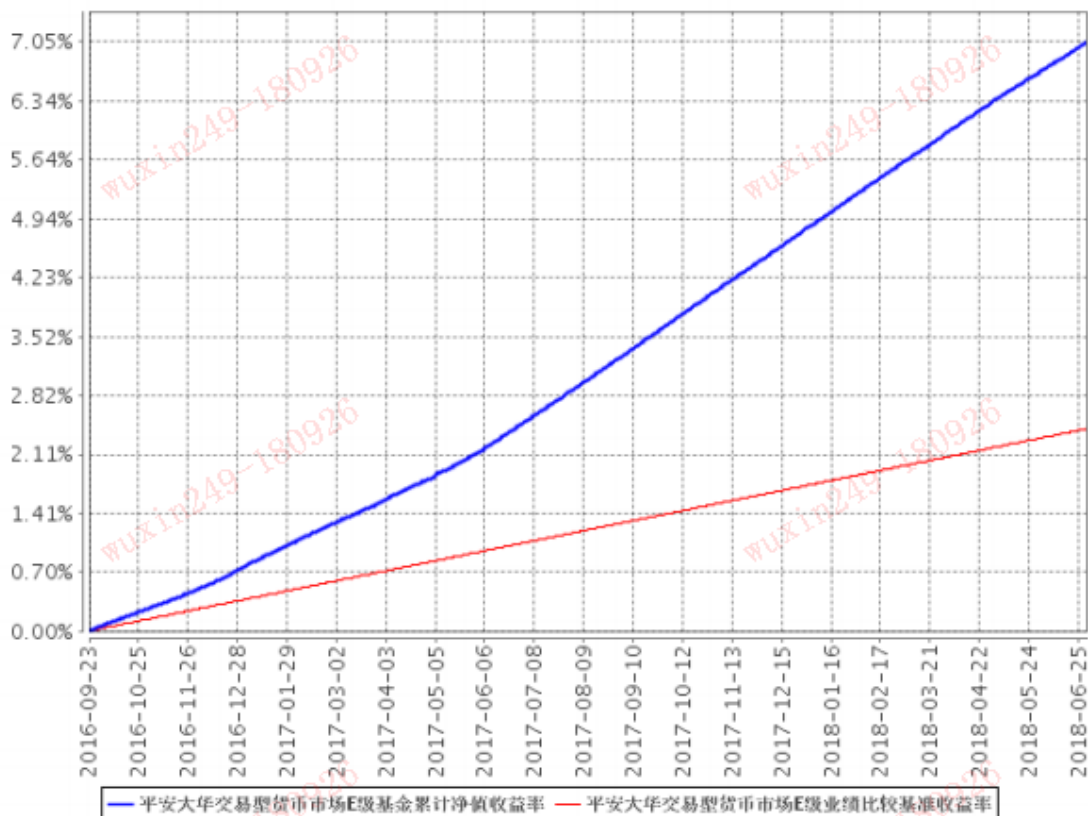
注：业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）。

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

平安大华交易型货币市场A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安大华交易型货币市场E级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于2016年9月23日正式生效，截至报告期已满两年；
- 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。

九、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、销售服务费；
- 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、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金上市费及年费；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 11、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

本基金管理费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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款指令，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0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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款指令，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、公休日等，支付日期顺延。

3、基金销售服务费

本基金的 A 类和 E 类基金份额的年销售服务费率均为 0.01%。

销售服务费计提的计算公式具体如下：

$$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第 4—11 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、费用调整

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。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十、 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） 2018年3月23日至2018年9月22日发布的公告：

1、2018年3月24日，关于平安大华交易型货币市场基金修改基金合同的公告；

2、2018年3月29日，平安大华交易型货币市场基金2017年年度报告以及摘要；

3、2018年3月30日，平安大华交易型货币市场基金2018年清明节前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告；

4、2018年4月20日，平安大华交易型货币市场基金2018年1季度报告；

5、2018年4月25日，平安大华交易型货币市场基金2018年劳动节前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告；

6、2018年5月5日，平安大华交易型货币市场基金招募说明书更新（2018年第1期）以及摘要；

7、2018年5月7日，平安大华交易型货币市场基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务限制的公告；

8、2018年5月29日，关于旗下部分基金新增万和证券股份有限公司为销售机构公告；

9、2018年6月30日，平安大华基金管理有限公司关于调整货币基金快速赎回业务限额的提示性公告；

10、2018年7月10日，关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构及开通基金转换业务、参与其费率优惠活动的公告；

11、2018年7月18日，平安大华交易型货币市场基金2018年第2季度报告；

12、2018年8月27日，平安大华交易型货币市场基金2018年半年度报告

以及摘要；

13、2018 年 9 月 22 日，平安大华交易型货币市场基金 2018 年国庆节前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告；

（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。

十一、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的要求及基金合同的规定，对2018年5月5日公布的《平安大华交易型货币市场基金招募说明书更新（2018年第1期）》进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，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“一、绪言”部分。
- 3、 根据最新资料，更新了“二、释义”部分。
- 4、 根据最新资料，更新了“三、基金管理人”。
- 5、 根据最新资料，更新了“四、基金托管人”。
- 6、 根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”。
- 7、 根据最新资料，更新了“十、基金份额的申购与赎回”。
- 8、 根据最新资料，更新了“十一、基金的投资”。
- 9、 根据最新资料，更新了“十二、基金的业绩”。
- 10、 根据最新资料，更新了“十四、基金资产的估值”。
- 11、 根据最新资料，更新了“十八、基金的信息披露”。
- 12、 根据最新资料，更新了“二十、风险揭示”。
- 13、 根据最新资料，更新了“二十一、基金合同的内容摘要”。
- 14、 根据最新资料，更新了“二十二、托管协议的内容摘要”。
- 15、 根据最新资料，更新了“二十三、对基金份额持有人的服务”。
- 16、 根据最新资料，更新了“二十四、其他应披露的事项”。
- 17、 根据最新情况，更新了“二十五、对招募说明书更新部分的说明”。
- 18、 根据最新情况，更新了“二十七、备查文件”。

平安大华基金管理有限公司

2018 年 11 月 3 日