

平安基金管理有限公司

平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券  
投资基金招募说明书更新（摘要）

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

2019 年 12 月

## 【重要提示】

平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2018 年 11 月 7 日证监许可[2018]1806 号文准予募集注册。本基金基金合同于 2018 年 12 月 21 日正式生效。

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投资价值、市场前景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。

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。投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

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，在投资本基金前，投资人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，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，获得基金投资收益，亦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，流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。特定风险包括：指数化投资的风险、标的指数的风险、跟踪偏离风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、基金赎回对价的变现风险、申购赎回清单差错风险、流动性风险、第三方机构服务的风险等。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券，还可少量投资于其他债券、货币市场工具、国债期货、银行存款、同业存单、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定），在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产

变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

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。

本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证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。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

根据基金合同的相关规定，本基金每日可设定申购份额、赎回份额上限，对于超出设定份额上限的申购、赎回申请，基金管理人有权予以拒绝。

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。

本基金采用优化抽样复制法跟踪标的指数，但由于基金费用、交易成本、组合持仓与标的指数成份券之间存在差异、基金估值方法与指数成份券取价规则之间存在差异等因素，可能造成本基金实际收益率与指数收益率存在偏离。

本基金属于债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金采用优化抽样复制策略，跟踪中证平安5-10年期国债活跃券指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

基金管理人根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》相关规定对本招募说明书做了调整。除上述事项外本招募说明书所载其他内容截止日期为2019年6月20日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为2019年3月31日。有关财务数据未经审计。

## 一、基金管理人

### 一、基金管理人概况

#### 1、基本情况

名称：平安基金管理有限公司

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130,000万元

存续期间：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	88,647	68.19%
大华资产管理有限公司	22,763	17.51%
三亚盈湾旅业有限公司	18,590	14.3%
合计	130,000	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、主要人员情况

### 1、董事、监事及高级管理人员

#### （1）董事会成员

罗春风先生,董事长，博士，高级经济师。1966年生。曾任中华全国总工会国际部干部，平安保险集团办公室主任助理、平安人寿广州分公司副总经理、平安

人寿总公司人事行政部/培训部总经理、平安保险集团品牌宣传部总经理、平安人寿北京分公司总经理、平安基金管理有限公司副总经理、平安基金管理有限公司总经理。现任平安基金管理有限公司董事长兼任深圳平安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，新加坡籍。曾任香港罗兵咸会计师事务所审计师；新鸿基证券有限公司执行董事；DBS 唯高达香港有限公司执行董事；平安证券有限责任公司副总经理；平安证券有限责任公司副董事长/副总经理；平安证券有限责任公司董事长；中国平安保险（集团）执行委员会执行顾问，现任集团投资管理委员会副主任。

肖宇鹏先生，董事，学士，1970年生。曾任职于中国证监会系统、平安基金管理有限公司督察长。现任平安基金管理有限公司总经理。

杨玉萍女士，董事，学士，1983年生。曾于平安数据科技（深圳）有限公司从事运营规划，现任平安保险（集团）股份有限公司人力资源中心薪酬规划管理部高级人力资源经理。

叶杨诗明女士，董事，硕士，1961年生，加拿大籍。曾任职于澳新银行、渣打银行、汇丰银行并担任高级管理职务。2011年加入大华银行集团，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，新加坡籍。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。

薛世峰先生，独立董事，硕士，1963年生。曾任江西省行政学院老师、深圳市龙岗区投资管理公司投资部部长、龙岗实业股份有限公司总经理、法定代表人、

深圳市鑫德莱实业有限公司总经理助理兼房地产部部长、监事会主席、法律顾问，后加入广东万乘律师事务所任专职律师，现任广东宏泰律师事务所高级合伙人、专职律师。

李娟娟女士，独立董事，学士，1965年生。曾任安徽商业高等专科学校教师、深圳兴粤会计师事务所项目经理、深圳职业技术学院经济系教师、会计专业主任、深圳职业技术学院计财处处长；现任深圳职业技术学院经济学院副院长。

刘雪生先生，独立董事，硕士，1963年生。曾任深圳蛇口中华会计师事务所审计员、深圳华侨城集团会计师、财务经理、子公司副总经理、总会计师、深圳市注册会计师协会部门临时负责人、秘书长助理；现任深圳市注册会计师协会副秘书长。

潘汉腾先生，独立董事，学士，1949年生。曾任新加坡赫乐财务有限公司助理经理、新加坡花旗银行副总裁、新加坡大华银行高级执行副总裁；现任彩日本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，新加坡籍。曾任职于淡马锡控股和旗下的富敦资产管理公司以及新加坡毕盛资产公司、鼎崴资本管理公司。于2013年加入大华资产管理，现任区域总办公室主管。

郭晶女士，监事，硕士，1979年生。曾任广东溢达集团研发总监助理、侨鑫集团人力资源管理岗；现任平安基金管理有限公司人力资源室副经理。

李峥女士，监事，硕士，1985年生。曾任德勤华永会计师事务所高级审计员、深圳市宝能投资集团财务部会计主管，现任平安基金管理有限公司监察稽核岗。

## （3）公司高管

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、平安基金管理有限公司副总经理、平安基金管理有限公司总经理。现任平安基金管理有限公司董事长，兼任深圳平安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、平安基金管理有限公司督察长。现任平安基金管理有限公司总经理。

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。现任平安基金管理有限公司副总经理。

汪涛先生，1976年生，毕业于谢菲尔德大学，金融硕士学位。曾任上海赛宁国际贸易有限公司销售经理、汇丰银行上海分行市场代表、新加坡华侨银行产品经理、渣打银行产品主管、宁波银行总行个人银行部总经理助理、总行审计部副总经理、总行资产托管部副总经理、永赢基金管理有限公司督察长。现任平安基金管理有限公司副总经理。

陈特正先生，督察长，学士，1969年生。曾任深圳发展银行龙岗支行行长助理，龙华支行副行长、龙岗支行副行长、布吉支行行长、深圳分行信贷风控部总经理、平安银行深圳分行信贷审批部总经理、平安银行总行公司授信审批部高级审批师、平安银行沈阳分行行长助理兼风控总监。现任平安基金管理有限公司督察长。

## 2、基金经理

成钧先生，上海交通大学博士，南京大学和上海证券交易所博士后，曾任职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017年2月加入平安基金管理有限公司，现任平安沪深

300 交易型开放式指数证券投资基金（2017-12-25 至今）、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（2018-03-23 至今）、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（2018-04-04-至今）、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金（2018-06-15 至今）、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金（2018-06-21 至今）、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（2018-09-05 至今）、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金（2019-03-15 至今）、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金（2019-07-30 至今）、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金（2019-07-30 至今）、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金（2019-09-23 至今）基金经理。

历任基金经理，李宪，2019 年 12 月 21 日至 2019 年 8 月 14 日任本基金基金经理。

### 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、平安基金管理有限公司督察长；现任平安基金管理有限公司总经理。

李化松先生，北京大学硕士。先后担任国信证券有限责任公司经济研究所分析师、华宝兴业基金管理有限公司研究部分析师、嘉实基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理。2018 年 3 月加入平安基金管理有限公司，现任权益投资中心投资董事总经理，同时担任平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金、平安核心优势混合型证券投资基金、平安高端制造混合型证券投资基金、平安安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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 月加入平安基金管理有限公司，任衍生品投资中心投资执行总经理。现任平安深证 300 指数增强型证券投资基金、平安沪深 300 指数



量化增强证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理。

张晓泉先生，清华大学材料科学与工程专业硕士，曾先后担任广发证券股份有限公司研究员、招商基金管理有限公司研究员、国投瑞银基金管理有限公司研究总监助理。2017年10月加入平安基金管理有限公司，任研究中心研究执行总经理。现担任平安新鑫先锋混合型证券投资基金基金经理。

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

上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，编制申购赎回清单；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

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、足额支付赎回对价；

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，按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

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、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“《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控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

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

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6）玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；

（7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基

金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（8）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

（9）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

（10）贬损同行，以提高自己；

（11）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（12）以不正当手段谋求业务发展；

（13）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（14）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律、行政法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，本基金相应调整禁止行为和投资限制规定。

#### 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

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。

#### 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。



## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

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 2018 年末，平安银行有 80 家分行，共 1,057 家营业机构。

2018 年，平安银行实现营业收入 1,167.16 亿元（同比增长 10.3%）、净利润 248.18 亿元（同比增长 7.0%）、资产总额 34,185.92 亿元（较上年末增长 5.2%）、吸收存款余额 21,285.57 亿元（较上年末增长 6.4%）、发放贷款和垫款总额（含贴现）19,975.29 亿元（较上年末增幅 17.2%）。

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2018年12月末，平安银行股份有限公司托管净值规模合计5.59万亿，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、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、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、平安安盈保本混合型证券投资基金、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、华润元大现金货币市场基金、平安鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、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、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、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、鹏华弘腾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、平安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、平安惠隆纯债债券型证券投资基金、平安金管家货币市场基金、平安鑫利定期开放灵活配置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、平安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、招商稳阳定期开放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、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、平安转型创新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、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、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安沪深300指数量化增强证券投资基金、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、华夏鼎旺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、博时富安纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金、富荣福锦混合型证券投资基金、前海开源丰鑫灵活配置混合型证券投资基金、平安中证500交易型开放式指数证券投资基金（ETF）、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、平安MSCI中国A股低波动交易型开放式指数证券投资基金（ETF）、平安合悦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、招商添荣3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安中证5-10年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金。

## 二、基金托管人的内部控制制度说明

### 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，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。

### 三、相关服务机构

#### 一、基金份额发售机构

##### 1、发售协调人

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：何之江

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)

##### 2、网下现金发售直销机构

平安基金管理有限公司

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

##### 3、申购赎回代办机构

###### (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](http://www.gtja.com)

(2) 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](http://www.newone.com.cn)

(3) 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)

(4) 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)

(5) 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)

(6) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：孔亚楠

联系电话：021-63325888

客服电话：95503

传真：021-63326173

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

(7) 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](http://www.foundersc.com)

(8) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

办公地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

法定代表人：何之江

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)

(9) 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)

(10) 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)

(11) 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)

(12) 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

**二、登记机构**

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

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**

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系人：陈颖华

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陈颖华

**四、审计基金财产的会计师事务所**

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

法定代表人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真电话：（021）23238800

经办注册会计师：曹翠丽、陈怡

联系人：陈怡

## 四、 基金的名称

平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金

## 五、 基金的类型

债券型证券投资基金

## 六、 基金的运作方式

交易型开放式

## 七、基金的投资

### 一、投资目标

紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。力争本基金的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差不超过 3%。

### 二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于其他债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券）、货币市场工具、国债期货、银行存款（包括协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款）、同业存单、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 三、标的指数

本基金的标的指数为中证平安 5-10 年期国债活跃券指数。

中证平安 5-10 年期国债活跃券指数由中证指数有限公司编制和发布，指数样本券由在沪深交易所和银行间市场上市的记账式付息国债中发行期限为 5 年、7 年和 10 年，对应剩余期限为 4-5 年、5.5-7 年和 8-10 年的债券组成，样本权重采用非市值加权计算。

如果指数发布机构变更或者停止标的指数编制及发布，或者标的指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致标的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时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若变更标的指数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、指数更名等事项），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。

## 四、投资策略

本基金主要采取优化抽样复制法。通过对标的指数中各成份国债的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的国债构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差不超过 3%。

如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

### （一）优化抽样策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于标的指数成份券和备选成份券。本基金将采用抽样复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所和银行间债券交易特性及交易惯例等情况，进行抽样优化调整，以实现对标的有效跟踪。

#### 1、债券投资组合管理的构建原则如下：

1) 投资标的以优化抽样配置标的指数成份券为目标，并综合考虑本基金资产规模、市场流动性和交易成本等因素对其逐步买入；

2) 当遇到包括但不限于成份券流动性不足、法律法规禁止本基金投资于相关券种、价格严重偏离合理估值、单只成份券交易量不符合市场交易惯例、基金规模太大或太小导致投资管理受到市场流动性和个券发行量的影响等情况，及预期标的指数成份券即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据相关市场情况，对个券权重和券种进行适当调整，或部分投资于备选成份券，以期在规定的风险承受限度之内，控制跟踪误差。

#### 2、债券投资组合的调整

##### 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债券的调整而进行相应调整。

##### 2) 不定期调整

a)基金管理人将基于久期、权重、信用等级、期限分布匹配的基础上，综合考虑样本券流动性、交易规模等因素，对债券投资组合进行动态抽样调整，以期实现对标的指数的有效跟踪。

b)若成份券遇到包括但不限于退市、流动性不足、法规限制或组合优化需要等情况，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

## （二）替代性策略

当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券及备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他债券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。替代组合的构建将以债券流动性为约束条件，按照与被替代债券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则，控制替代组合与被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。构建替代组合的方法如下：

1、按照与被替代债券久期、信用评级相似和交易市场相同的原则，在其他可投资标的中选择成份券替代券库；

2、采用成份券替代券库中的各券过去较长一段时间的历史数据，分析其与被替代债券的相关性，选择正相关度较高的债券进一步考察；

3、分析上述债券的流动性，综合流动性和相关度两个指标挑选替代券，从而使得替代组合与被替代债券的跟踪误差最小化。

## （三）债券投资策略

对于非成份券的债券，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。另外，本基金债券投资将适当运用杠杆策略，通过债券回购融入资金，然后买入收益率更高的债券以获得收益。

1、久期管理策略是根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金资产风险。

2、收益率曲线策略是指在确定组合久期以后，根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理，确定组合期限结构的分布方式，合理配置不同期限品种的配置比例。

3、类属配置包括现金、不同类型固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上，根据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确

定各子类资产的配置权重，即确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例。

#### （四）中小企业私募债券投资策略

针对中小企业私募债券，本基金以持有到期，获得本金和票息收入为主要投资策略，同时，密切关注债券的信用风险变化，力争在控制风险的前提下，获得较高收益。本基金投资中小企业私募债，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，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

#### （五）国债期货投资策略

基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

#### （六）资产支持证券投资

深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用蒙特卡罗方法等数量化定价模型，评估其内在价值，并结合资产支持证券类资产的市场特点，进行此类品种的投资。

### 五、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；
- （2）本基金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%，但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；
- （3）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%，但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；
- （4）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%；
- （5）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%；
- （6）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%；

(7) 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%；

(8) 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；

(9) 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%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(10) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(11) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(12) 本基金持有单只企业中期票据，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(13) 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 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(14) 本基金参与国债期货交易，遵循以下中国证监会规定的投资限制：

i) 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%；

ii) 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%；

iii) 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%；

iv) 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；

v) 本基金每个交易日日终在扣除国债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。其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；

（15）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%；

（16）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%；

（17）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基金合同约定的投资范围保持一致；

（18）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；

（19）法律法规及中国证监会规定的和基金合同规定的其他投资限制。

除上述第（8）、（13）、（17）项外，因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份券调整、标的指数成份券流动性限制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。

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基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 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）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。

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。

若将来法律、行政法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

## 六、基金管理人代表基金行使股东和债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东和债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、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；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、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。

## 七、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证平安 5-10 年期国债活跃券指数收益率。

若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代（其编制方法发生实质性变更的）、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为原标的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时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在按监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数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单位变更、指数更名、标的指数由其他指数替代（其

编制方法未发生实质性变更的)等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和对基金合同进行相应修改(包括但不限于基金名称变更),报中国证监会备案并及时公告。

## 八、风险收益特征

本基金属于债券型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。本基金采用优化抽样复制策略,跟踪中证平安5-10年期国债活跃券指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

## 九、基金投资组合报告

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2019年3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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,133,581,500.00	97.71
	其中:债券	1,133,581,500.00	97.71
	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	2,000,000.00	0.17
	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	9,886,105.32	0.85
8	其他资产	14,695,572.66	1.27
9	合计	1,160,163,177.98	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

本基金本报告期末未持有股票。

**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**

本基金本报告期末未持有股票。

**1.2.3 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****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**

本基金本报告期末未持有股票。

**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**

本基金本报告期末未持有股票。

**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	1,133,581,500.00	97.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,133,581,500.00	97.75

**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	180023	18 付息国债 23	2,500,000	254,075,000.00	21.91
2	180028	18 付息国债 28	1,900,000	191,216,000.00	16.49

3	180027	18 付息国债 27	1,300,000	131,989,000.00	11.38
4	019601	18 国债 19	900,000	93,303,000.00	8.05
5	019598	18 国债 16	900,000	91,287,000.00	7.87

## 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 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

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

### 1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## 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

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

### 1.10.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 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

报告期内，本基金未参与股票交易。

### 1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,128.18
2	应收证券清算款	722.46
3	应收股利	-
4	应收利息	14,397,248.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	289,473.70
8	其他	-
9	合计	14,695,572.66

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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。

## 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（2018年12月21日）至2019年3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

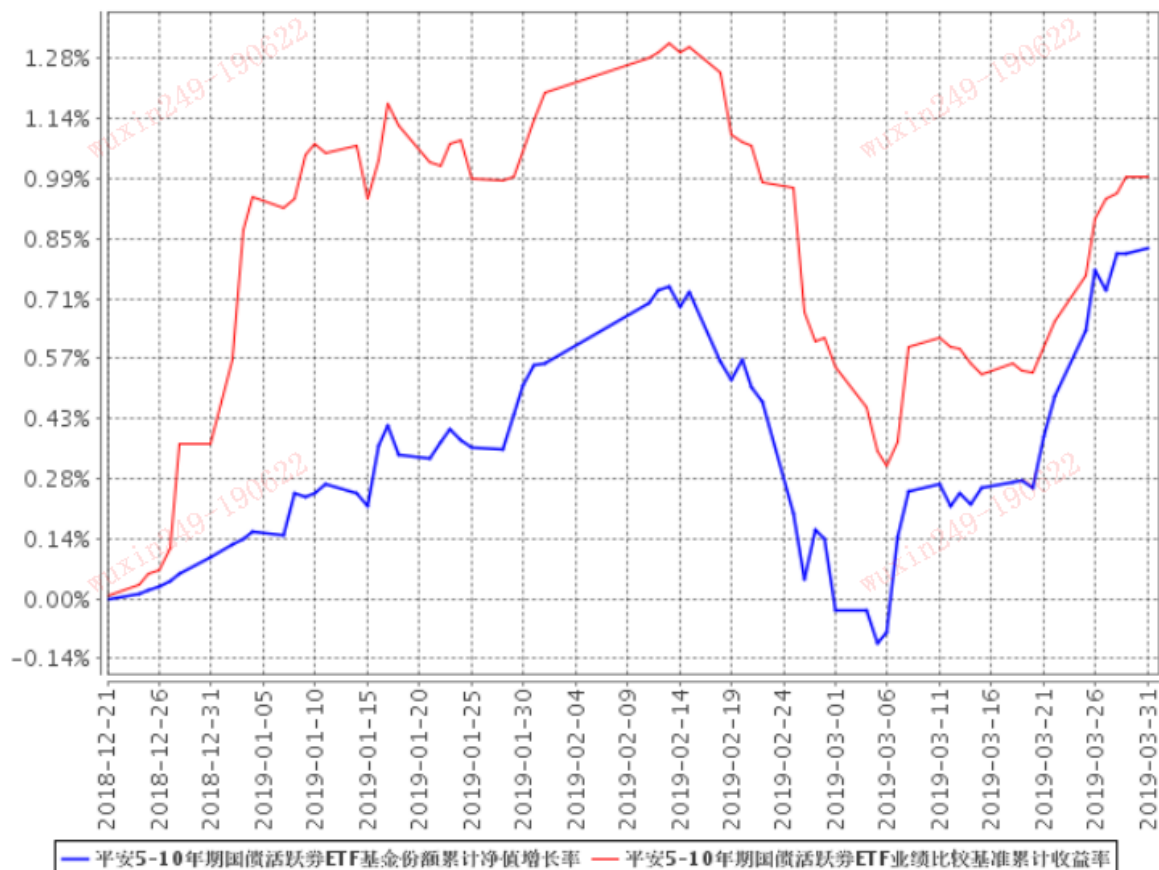
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.12.21-2018.12.31	0.10%	0.01%	0.37%	0.09%	-0.27%	-0.08%
2019.1.1-2019.3.31	0.73%	0.08%	0.63%	0.09%	0.10%	-0.01%
自基金成立以来	0.83%	0.08%	1.00%	0.09%	-0.17%	-0.01%

本基金的业绩比较基准为：中证平安5-10年期国债活跃券指数收益率\*100%



## 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5-10年期国债活跃券ETF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2018年12月21日正式生效，截至报告期已满半年；
- 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、律师费和诉讼费；
- 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、基金的上市费及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；
- 9、基金合同生效后的标的指数许可使用费；
- 10、基金的开户费用、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

### 3、标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。在通常情况下，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.02%的年费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

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

H为每日应付的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费按季支付。根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的规定，指数许可使用费的收取下限为每季人民币25,000元（即不足25,000元部分按照25,000元收取），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

若中证指数有限公司与基金管理人对指数许可使用费的费率及支付方式另有约定的，从其最新约定。

4、上述“一、基金费用的种类”中除管理费、托管费和标的指数许可使用费之外的其他费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，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12月21日至2019年6月20日发布的公告：

1、2018年12月22日，关于平安中证5-10年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告；

2、2019年1月3日，平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告；

3、2019年1月17日，关于不法分子冒用“花生宝”名义开展非法金融业务的严正声明；

4、2019年1月22日，关于平安中证5-10年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告；

5、2019年1月26日，关于平安中证5-10年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告；

6、2019年2月12日，平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告；

7、2019年2月19日，平安中证5-10年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书；

8、2019年2月22日，关于平安中证5-10年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金开放申购赎回业务的公告；

9、2019年3月23日，关于平安中证5-10年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代办券商的公告；

10、2019年3月28日，关于平安中证5-10年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代办券商的公告；

11、2019年4月18日，平安中证5-10年期国债活跃券交易型开放式指数证

券投资基金 2019 年第 1 季度报告；

12、2019 年 5 月 22 日，关于旗下部分基金新增申购赎回代办机构的公告；

13、2019 年 6 月 6 日，关于平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金新增招商证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告；

（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》等其他相关法律法规的要求及基金合同的规定，对2019年7月17日公布的《平安中证5-10年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新（2019年第1期）》进行了更新，本次重大更新事项为依据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订“基金信息披露”章节及相关内容。

平安基金管理有限公司

2019年12月21日