

**平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金  
招募说明书（更新）摘要  
2018年第1期**

**基金管理人：平安大华基金管理有限公司  
基金托管人：平安银行股份有限公司**

二〇一八年四月

## 【重要提示】

平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1046号文注册募集。本基金的基金合同于2017年11月1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价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

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。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、本基金特有的风险等。

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。

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本招募说明书（2018 年第 1 期）所载内容截止日期为 2018 年 4 月 30 日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为 2018 年 3 月 31 日。有关财务数据未经审计。

本基金托管人平安银行股份有限公司于 2018 年 5 月 24 日对本招募说明书(2018 年第 1 期) 进行了复核。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：平安大华基金管理有限公司

住所：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

成立日期：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

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。

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

## 2、基金经理

施旭先生，哥伦比亚大学金融数学硕士，曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券，于2015年加入平安大华基金，任衍生品投资中心量化研究员，现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金（2016-05-19至今）、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金（2016-11-02至今）、平安大华鑫享混合型证券投资基金（2016-12-27至今）、平安大华鑫安混合型证券投资基金（2016-12-27至今）、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金（2017-01-25至今）、平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金（2017-05-17至今）、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金（2017-05-11至今）、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金（2017-11-01至今）、平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金（2018-02-01至今）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（2017-09-05至今）、平安大华沪深300指数量化增强证券投资基金（2017-12-26至今）、平安大华鑫荣混合型证券投资基金（2017-09-12至今）、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金（2018-01-23至今）、平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金（2018-03-07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，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，但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；
- 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前提下得到有关资料的复印件；
- 18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托

管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为； 24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### （四）基金管理人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。

#### **（五）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，但是法律法规或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。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，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或按变更后的规定执行。

### （六）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、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

### （七）基金管理人的内部控制制度

#### 1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

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。

## 2、内部控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

独立性原则。公司各机构、部门、和岗位在职能上应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性，运用科学化的方法尽量降低经营运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 3、主要内部控制制度

### （1）内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

### （2）风险控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。

### （3）监察稽核制度

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。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：谢永林

成立日期：1987年12月22日

组织形式：股份有限公司

注册资本：17,170,411,366元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037号

联系人：高希泉

联系电话：(0755) 2219 7701

#### 1、平安银行基本情况

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行，证券代码000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司，于2012年6月吸收合并原平安银行并于同年7月更名为平安银行。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行58%的股份，为平安银行的控股股东。截至2017年末，在职员工32502人，通过全国70家分行、1079家营业机构为客户提供多种金融服务。

2017年，平安银行收入、利润、规模保持稳健发展。实现营业收入1057.86亿元（还原营改增前的营业收入同比增幅1.67%）、净利润231.89亿元（同比增长2.61%）、资产总额32,484.74亿元（较上年末增长9.99%）、吸收存款余额20,004.20亿元（较上年末增长4.09%）、发放贷款和垫款总额（含贴现）17,042.30亿元（较上年末增幅15.48%）。

平安银行总行设资产托管事业部，下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、



资金清算处、规划发展处、IT系统支持处、督察合规处、基金服务中心8个处室，目前部门人员为60人。

## 2、主要人员情况

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

## 3、基金托管业务经营情况

2008年8月15日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。

截至2017年12月末,平安银行股份有限公司托管净值规模合计6.13万亿,托管证券投资基金共109只,具体包括华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、招商保证金快线货币市场基金、平安大华日增利货币市场基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金、平安大华财富宝货币市场基金、红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华活期添利货币市场证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、鹏华安盈宝货币市场基金、平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金、

新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、嘉合磐石混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金、博时裕泰纯债债券型证券投资基金、德邦增利货币市场基金、中海顺鑫保本混合型证券投资基金、民生加银新收益债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金、博时裕景纯债债券型证券投资基金、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、嘉实稳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、平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金、南方荣欢定期开放混合型发起式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中海合嘉增强收益债券型证券投资基金、鹏华丰安债券型证券投资基金、富兰克林国海新活力灵活配置混合型证券投资基金、南方颐元债券型发起式证券投资基金、鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金、鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金、西部利得天添利货币市场基金、鹏华弘腾灵活配置混合型证券投资基金、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠享纯债债券型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠利纯债债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金、鹏华丰盈债券型证券投资基金、平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、平安大华金管家货币市场基金、平安大

华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金、博时泰安债券型证券投资基金、新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金、国联安睿智定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、前海开源聚财宝货币市场基金、招商招弘纯债债券型证券投资基金、招商稳阳定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金、前海开源沪港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、西部利得汇享债券型证券投资基金、鹏华丰玉债券型证券投资基金、华安睿安定期开放混合型证券投资基金、西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金、广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金、南方和元债券型证券投资基金、长盛盛通纯债债券型证券投资基金、平安大华添益债券型证券投资基金、平安大华惠元纯债债券型证券投资基金、中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金、兴银消费新趋势灵活配置混合型证券投资基金、南方高元债券型发起式证券投资基金、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金、中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金、中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、南方智造未来股票型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、嘉实稳悦纯债债券型证券投资基金、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安大华沪深 300 指数量化增强证券投资基金。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

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

保业务的安全、稳健运行，促进经营目标的实现。

## 2、内部控制组织结构

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

## 3、内部控制制度及措施

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

# 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

## 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用行业普遍使用的“资产托管业务系统——监控子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## 2、监督流程

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

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

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

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

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额销售机构

##### 1、直销机构

平安大华基金管理有限公司

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

法定代表人：罗春风

电话：0755-22627627

传真：0755-23990088

联系人：尹延君

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

##### 2、其他销售机构

###### （1）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：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)

###### （2）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：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)

(3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

联系人：曹榕

联系电话：021-58781234

客服电话：95559

传真：021-58408483

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

(4) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

联系人：王晓琳

联系电话：010-89937325

传真：010-65550827

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

(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) 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

(7) 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

(8) 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

(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) 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

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

(13) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：丁益

联系人：金夏

联系电话：0755 -83516289

客服电话：400-6666-888

传真：0755-83515567

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

(14) 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)

(15) 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](http://www.njzq.cn)

(16) 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

(17) 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

(18) 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：祁昊

电话：051082831662

传真：0510-82830162

客服电话：95570

网址：www.glsc.com.cn

(19) 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

(20) 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

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(24) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

办公地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：王宜四

联系人：刘小莹

联系电话：0755-83689020

传真：010-64818443

客服电话：95335

网址：www.scstock.com

(25) 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

(26) 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

(27) 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

(28) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

电话：028-86690057、028-86690058

客服电话：95310

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

(29) 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>

(30) 上海基煜基金销售有限公司

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

办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话：021-65370077

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

(31) 海银基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室

法定代表人：刘惠

联系人：毛林

客服电话：400-808-1016

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

(32) 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

(33) 中国平安人寿保险股份有限公司（仅代销 A 类）

注册地址：深圳市福田区中心区福华三路星河发展中心办公 9、10、11 层

办公地址：深圳市福田区中心区福华三路星河发展中心办公 9、10、11 层

法定代表人：丁新民

联系人：张露

电话：021-38635631

传真：021-50475630

客服电话：95511 转 1

网址：<http://life.pingan.com/>

(34) 华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层

办公地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层

法定代表人：路昊

联系人：茆勇强

电话：021-61058785

传真：021-61098515

客服电话：400-111-5818

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

(35) 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

（36）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

（37）上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

（38）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼

法定代表人：肖雯

联系人：吴煜浩

电话：020-89629021

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

## （二）登记机构

平安大华基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层

法定代表人：罗春风

电话：0755-22624581

传真：0755-23990088

联系人：张平

## （三）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）2323 8888

传真电话：（021）2323 8800

经办注册会计师：曹翠丽、张宁

联系人：张宁

#### 四、基金的名称

平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金

#### 五、基金的类型

混合型发起式证券投资基金

#### 六、基金的运作方式

契约型开放式

## 七、基金的投资

### （一）投资目标

本基金利用数量化投资模型指导投资组合的构建，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### （二）投资范围

本基金的投资对象是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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债），资产支持证券，债券回购、银行存款（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、货币市场工具，权证、股指期货、国债期货，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。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%。本基金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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### （三）投资策略

本基金采用数量化投资策略建立投资模型，采用自上而下的资产配置和自下而上的个股选择相结合的方式，切实贯彻数量化的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。

本基金的投资策略包括两部分：一是通过自上而下的资产配置策略确定各类标的资产的配置比例，并对组合进行动态管理，进一步优化整个组合的风险收益参数；

二是通过自下而上的上市公司的基本面数据、交易所公开信息、资本/资金市场数据、分析师预期数据、以及其他对股票选取有帮助的公开数据，构建数量化的多因子模型，选取具有投资价值的上市公司股票构成最终的股票投资组合。

### 1、资产配置策略

本基金采用“自上而下”的资产配置方法，确定本基金资产在股票、债券及其他金融工具等类别资产间的分配比例。在具体的资产配置过程中，通过把握宏观经济增长的长期趋势，短期的经济周期波动以及政策导向，判断各类资产的风险程度和收益特征，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，合理调整股票资产、债券资产和其他金融工具的比例，以达到控制风险、增加收益的目的。

### 2、量化多因子股票投资策略

本基金主要通过数量化投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金利用长期积累并实时扩展的数据库，科学地考虑了大量的各类信息，并运用基金管理人自行开发的量化多因子模型框架，综合基本面因子、量价技术面因子以及分析师预期因子优选股票，基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，结合收益与风险的波动性，适时调整组合的持股组成以及个股的资金权重。模型主要包含但不限于以下因子：

（1）基本面因子：主要包括公司的基本面信息，主要包括净利润长期和短期增长情况，主营业务收入长期和短期增长情况，公司业绩预告超越市场预期的幅度，公司最近重要新闻事件的发生，例如：新产品上市、新收购、新管理层上任等，个股流动性供应，包括：流通市值、解禁计划；

（2）量价技术面因子：通过研究分析个股二级市场价格和交易量数据，挖掘股价的增长与反转模式，作为选股的依据；

（3）分析师预期因子：包括分析师投资评级及其变化、上市公司年度净利润一致预期及其变化、分析师关注度及其变化等反映上市公司动态成长性指标。

### 3、量化价值成长策略

本策略综合考虑股票的长期稳定增长性和和单期增长性，对处于成长阶段的上市公司收入增长、利润增长的稳定性和持续性进行评估，同时也对毛利率，净利润

率等盈利质量指标进行跟踪，并考察分析师对该股的盈利预测。

#### 4、事件驱动策略

该策略通过对某些公司事件和市场事件的研究，分析事件对股价造成波动的方向，以赚取超额收益。此外，该策略还利用市场上存在的金融产品定价非有效性，实现套利收益。

#### 5、债券投资策略

本基金将根据需要，适度进行债券投资。本基金在严格控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架，通过对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测，进行以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标的债券投资。

本基金对中小企业私募债券的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面展开。久期控制方面，根据宏观经济运行状况的分析和预判，灵活调整组合的久期。信用风险控制方面，对个券信用资质进行详尽的分析，对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考量，尽可能地缩小信用风险暴露。流动性控制方面，要根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模，在力求获取较高收益的同时确保整体组合的流动性安全。

#### 6、权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

#### 7、股指期货等投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益

性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### 8、资产支持证券投资策略

本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

#### 9、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，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。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

### （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）本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%–95%；
- （2）本基金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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(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%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金投资股指期货或国债期货，在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入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、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出

股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定，即占基金资产的比例为 60%-95%；

（16）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%；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%；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；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%；

（17）本基金持有的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%；

（18）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（19）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%；

（20）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；

（21）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；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（12）、（20）、（21）项所规定的情形外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规

定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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。

如果法律法规或监管部门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，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，但是法律法规或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的原则，防范利益冲突，符合中国证监会的规定，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。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，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或按变更后的规定执行。

## 五、业绩比较基准

中证 500 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

选择该业绩比较基准，是基于以下因素：

1、中证 500 指数和中证综合债指数合理、透明；

2、中证综合债指数具有较高的知名度和市场影响力；

3、基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用该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基准的指数时，本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下，报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金，属于风险水平较高的基金。

## 七、基金管理人代表基金行使所投资证券项下权利的原则及方法

基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使所投资证券项下得权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使所投资证券项下权利时应遵守以下原则：

1、不参与所投资公司的经营管理，不谋求对上市公司的控股；

2、有利于基金财产的安全与增值，有利于保护基金份额持有人的合法权益。

## 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 2018 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	10,094,859.76	36.54
	其中：股票	10,094,859.76	36.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	5,000,000.00	18.10
	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	12,473,136.20	45.15
8	其他资产	57,787.55	0.21
9	合计	27,625,783.51	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	199,857.00	1.00
C	制造业	4,593,382.76	22.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88,110.00	0.44

E	建筑业	273,820.00	1.37
F	批发和零售业	111,106.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	244,140.00	1.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,963,643.00	9.81
J	金融业	1,573,858.00	7.86
K	房地产业	209,776.00	1.05
L	租赁和商务服务业	79,365.00	0.40
M	科学研究和技术服务业	67,152.00	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	328,614.00	1.64
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	362,036.00	1.81
S	综合	-	-
	合计	10,094,859.76	50.43

### 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	300059	东方财富	20,900	353,837.00	1.77
2	300124	汇川技术	8,200	289,952.00	1.45
3	300136	信维通信	7,300	272,363.00	1.36
4	300072	三聚环保	7,800	252,720.00	1.26
5	600837	海通证券	20,100	230,949.00	1.15
6	000703	恒逸石化	8,300	215,883.00	1.08

7	300408	三环集团	8,900	214,757.00	1.07
8	300070	碧水源	11,800	213,816.00	1.07
9	600519	贵州茅台	300	205,086.00	1.02
10	300024	机器人	9,300	194,277.00	0.97

#### 1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资情况。

#### 1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券投资。

#### 1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末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

海通证券股份有限公司（以下简称“公司”）于2017年5月25日公告，公司近日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2017]59号）。因公司违反了《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告【2011】31号）第十一条的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项“未按照规定与客户签订业务合同，或者未在与客户的业务合同中载入规定的必要条款”所述行为，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项的规定，中国证监会拟决定：一、责令海通证券改正，给予警告，没收违法所得509,653.15元，并处罚款2,548,265.75元；二、对左秀海、徐晓啸、朱元灏给予警告，并分别处以10万元罚款。

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中，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	20,514.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,499.97
5	应收申购款	35,773.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,787.55

**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	000703	恒逸石化	215,883.00	1.08	重大事项

**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（2017年11月1日）至2018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：

### 平安大华量化先锋 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017.11.1-2017.12.31	0.40%	0.66%	-3.79%	0.83%	4.19%	-0.17%
2018.1.1-2018.3.31	-1.40%	1.11%	-1.24%	1.20%	-0.16%	-0.09%
自合同成立以来	-1.01%	0.94%	-4.98%	1.06%	3.97%	-0.12%

业绩比较基准：中证500指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%

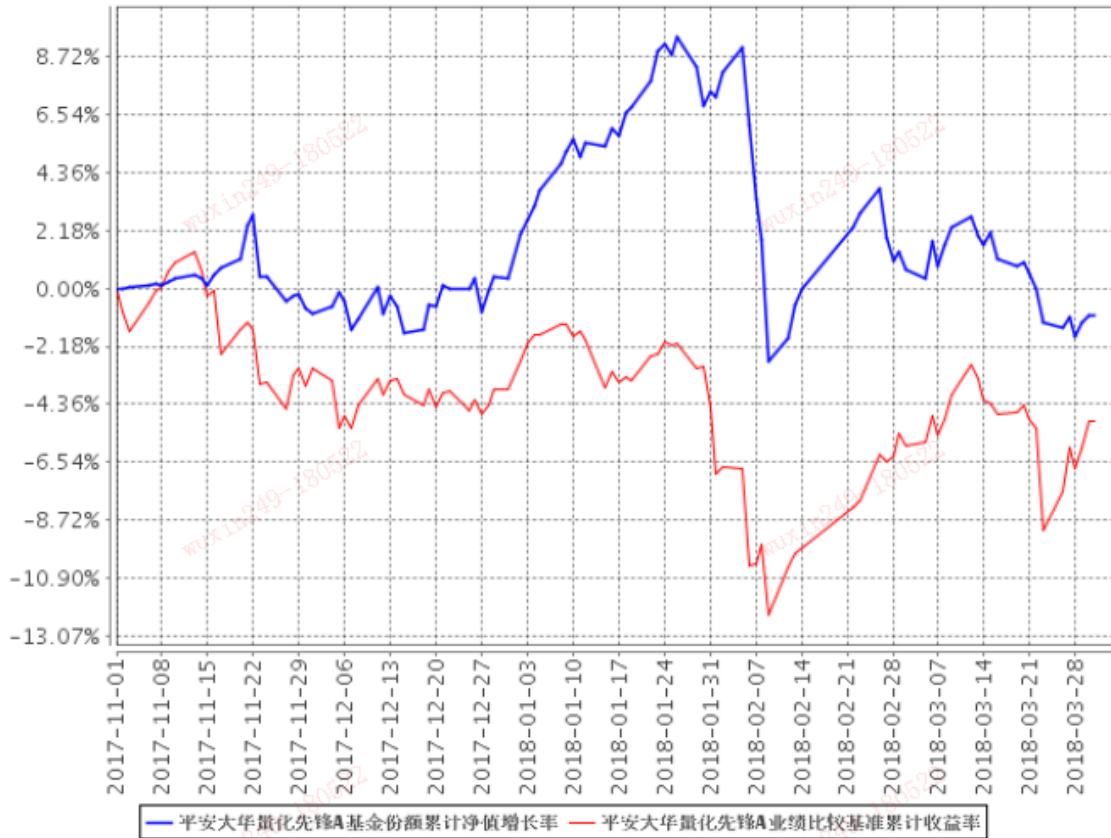
### 平安大华量化先锋 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017.11.1-2017.12.31	0.26%	0.66%	-3.79%	0.83%	4.05%	-0.17%
2018.1.1-2018.3.31	-1.69%	1.11%	-1.24%	1.20%	-0.45%	-0.09%
自合同成立以来	-1.43%	0.94%	-4.98%	1.06%	3.55%	-0.12%

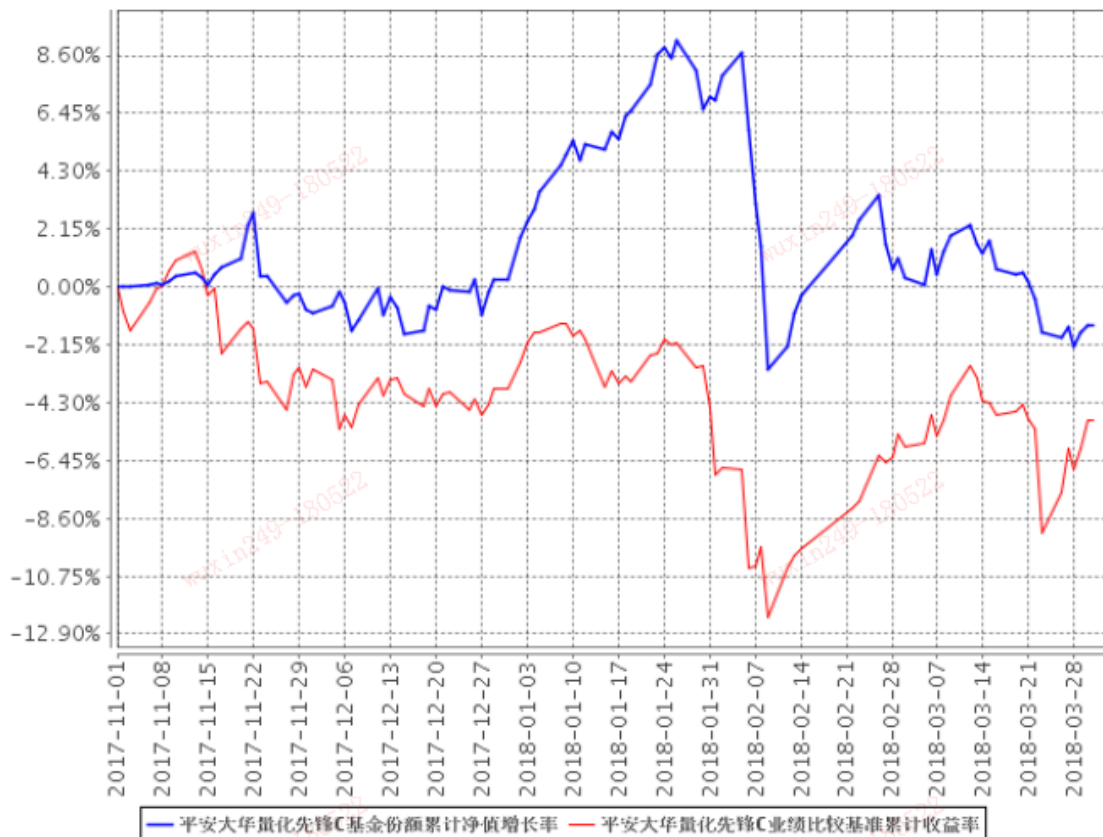
业绩比较基准：中证500指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%

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

平安大华量化先锋A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



平安大华量化先锋C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于2017年11月1日正式生效，截至报告期末未满一年；  
 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，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## 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、审计费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金相关账户的开户及维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按与基金管理人协商一致的方式于次月前 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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按与基金管理人协商一致的方式于次月前 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 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.80% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为本基金 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为本基金 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于次月前 5 个工作日内从基金财产中划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 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）2017年11月1日至2018年4月30日发布的公告：

1、2017年11月2日，关于平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告；

2、2017年12月18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；

3、2017年12月19日，关于平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务和定期定额投资的公告；

4、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；

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24日，平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告；

8、2018年2月6日，关于旗下部分基金新增华瑞保险销售有限公司为销售机构的公告；

9、2018年3月1日，关于旗下部分基金新增中国平安人寿保险股份有限公司为销售机构的公告；

10、2018年3月24日，关于平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金修改基金合同的公告

11、2018年3月26日，平安大华基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金赎回费的公告；

12、2018年4月16日，关于旗下部分基金新增海银基金为销售机构及开通定



投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告；

13、2018年4月20日，平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金2018年1季度报告；

（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2017年8月25日公布的《平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书》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“第一部分、绪言”。
- 3、根据最新资料，更新了“第二部分、释义”。
- 4、根据最新资料，更新了“第三部分、基金管理人”。
- 5、根据最新资料，更新了“第四部分、基金托管人”。
- 6、根据最新资料，更新了“第五部分、相关服务机构”。
- 7、根据最新资料，更新了“第六部分、基金的募集”。
- 8、根据最新资料，更新了“第七部分、基金合同的生效”。
- 9、根据最新资料，更新了“第八部分、基金份额的申购与赎回”。
- 10、根据最新资料，更新了“第九部分、基金的投资”。
- 11、根据最新资料，更新了“第十部分、基金的业绩”。
- 12、根据最新资料，更新了“第十二部分、基金资产的估值”。
- 13、根据最新资料，更新了“第十六部分、基金的信息披露”。
- 14、根据最新资料，更新了“第十七部分、风险揭示”。
- 15、根据最新资料，更新了“第二十部分、基金托管协议的内容摘要”。
- 16、根据最新资料，更新了“第二十二部分、其他应披露的事项”。
- 17、根据最新情况，更新了“第二十三部分、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5月29日