

# 太平灵活配置混合型发起式证券投资基金 招募说明书（更新）摘要

（2019 年第 2 号）

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

## 重要提示

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2014年12月24日中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1392号文注册募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。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及市场前景等作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同等信息披露文件，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。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险。本基金面临的主要风险是市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险及本基金的特定风险等。

本基金是混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高预期风险和中高预期收益产品。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，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，包括但不限于：市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、本基金的特定风险等。本基金投资中小企业私募债券，其存在较高的流动性风险和信用风险，尽管本基金将中小企业私募债券的投资比例控制在一定范围内，但仍提请投资者关注中小企业私募债存在的上述风险及其对基金总体风险的影响。

本基金为发起式基金，在基金募集时，发起资金认购本基金的金额不低于1000万元，且发起份额的持有期限不低于三年。发起份额持有期限满三年后，发

起份额持有人将根据自身情况决定是否继续持有，届时，发起份额持有人可能赎回认购的本基金份额。另外，基金合同生效之日起三年内，若基金资产规模低于2亿元，基金合同自动终止，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现。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。

投资有风险，投资者在投资本基金前，应当认真、仔细阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，全面了解本基金的风险收益特征和产品特性，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，理性判断市场，谨慎、独立做出投资决策，承担基金投资中出现的各类风险，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买和赎回基金。

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，但不保证投资本基金一定盈利，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资产净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金单一投资者持有的基金份额数量不得达到或者超过本基金基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。本招募说明书（更新）所载内容截止日为2019年8月10日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年6月30日（财务数据未经审计）。

**一、基金合同生效日期：2015年2月10日**

**二、基金管理人**

（一）基金管理人概况

名称：太平基金管理有限公司

住所：中国上海市虹口区邯郸路135号5幢101室

办公地址：中国上海浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室

法定代表人：汤海涛

设立日期：2013年1月23日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会 证监许可[2012]1719号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币4亿元

存续期限：持续经营

联系人：熊勇文

客户服务电话：021-61560999

传真：021-38556751

股权结构：

股东名称	持股比例
太平资产管理有限公司	83.00%
中原证券股份有限公司	8.50%
安石投资管理有限公司	8.50%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

汤海涛先生，董事长。中共党员，经济及管理学硕士。具有证券投资基金从业资格。现任太平资产管理有限公司党委委员、副总经理，本公司董事长。曾任交通银行股份有限公司哈尔滨分行核算运行中心副主任、会计结算部高级经理，交通银行股份有限公司大庆分行党委书记、行长；太平资产管理有限公司市场部

总经理、北方项目事业部总经理、产品开发部总经理；太平养老保险股份有限公司投资总监等职。

徐钢先生，董事。中共党员，经济学硕士，高级经济师。现任太平资产管理有限公司副总经理。曾任中国人寿保险（集团）公司投资管理部资产配置处、股权管理处负责人；太平资产管理有限公司股权投资事业部总经理、组合管理部总经理、创新发展部副总经理（主持工作）、助理总经理等职。

邱宏斌先生，董事。中共党员，经济学硕士。具有证券投资基金从业资格。现任本公司总经理。曾任大连信托投资公司证券部投资经理、上海证券营业部总经理；大通证券股份有限公司营业部总经理、华东区总经理；泰信基金管理有限公司高级研究员、理财顾问部总经理；光大保德信基金管理有限公司专户理财部投资总监；泰信基金管理有限公司总经理助理兼专户投资总监；太平资产管理有限公司资产管理事业部总经理、产品开发部总经理、投资管理中心副总经理，太平基金管理有限公司副总经理等职。

吴东先生，董事。中共党员，政治学理论硕士，具有证券投资基金从业资格、仲裁员资格、律师资格。现任本公司副总经理。曾任上海市司法局办公室副主任；中国人寿保险股份有限公司上海分公司内控合规部总经理；中国人寿保险股份有限公司上海分公司宝山支公司总经理；太平资产管理有限公司风险管理部/项目评审部副总经理（部门总经理级）、监察部总经理、风险管理及合规部总经理等职。

宋卫华先生，董事。中共党员，数量经济学硕士。具有证券投资基金从业资格。现任本公司副总经理。曾任河南省驻马店市第三中学教师，东北财经大学数量经济研究所助理研究员，河南财政证券公司期货部业务主管、总经理助理兼投资部经理，中原证券股份有限公司证券投资总部副总经理、上海大连西路营业部副总经理、研究所副所长等职，中原英石基金管理有限公司副总经理。

Thomas Adam Shippey 先生，董事。英国阿斯顿大学国际商务和德语学士。现任安石集团战略发展总监兼安石集团财务总监。曾任普华永道会计师事务所注册会计师，瑞银集团任执行董事职务。

胡志浩先生，独立董事。中共党员，金融学博士。现任国家金融与发展实验室全球经济与金融研究中心主任。曾任职于中国社会科学院金融研究所、国家金融与发展实验室。

赵然女士，独立董事。经济学博士。现任河南省社科院金融财贸所负责人、副研究员，《河南金融发展报告暨河南金融蓝皮书》副主编。曾任职于跨国公司、投资银行等相关企业。

于春海先生，独立董事。经济学博士。现任中国人民大学经济学院国际经济系主任、中国人民大学国家发展与战略研究院特聘研究员、中国特色社会主义经济建设协同创新中心研究员、中信改革发展研究院资深研究员及瞭望智库入驻专家。曾任职于中国航天工业总公司第三研究院第三设计部任助理工程师。

## 2、监事会成员

陈沫先生，监事会主席。民革党员，工商管理硕士。现任太平资产管理有限公司信息技术部总经理。曾任职于太平人寿保险公司，曾任太平资产管理有限公司运营保障部副总经理、信息技术部副总经理、运营管理部副总经理等职。

曹燕萍女士，监事。中共党员，经济学硕士。现任太平资产管理有限公司研究部总经理。曾任申银万国证券研究所经理助理、高级研究员、能源小组组长，海富通基金管理有限公司高级研究员、绝对收益组基金经理，国金证券研究所研究总监等职。

谢雪竹女士，监事。中共党员，经济学硕士。现任中原证券股份有限公司合规总监。曾任河南财政证券公司驻武汉证券交易中心及河南证券交易中心交易员、总经理秘书（公司中层），中原证券股份有限公司督察室主任、经纪业务总部副总经理、郑州商城路营业部总经理、公司办公室主任、董事会秘书、首席风险官兼合规管理总部（法律事务总部）总经理等职务。

白莉莉女士，职工监事。中共党员，国际贸易学硕士。具有证券投资基金从业资格。现任本公司机构业务部副总监。曾任中信建投证券有限责任公司理财经

理，金鹰基金管理有限公司渠道经理，太平资产管理有限公司金融市场部高级业务副总裁等职。

张健先生，职工监事。金融工程硕士。具有证券投资基金从业资格。现任本公司产品管理部副总监。曾任交银施罗德基金管理有限公司产品经理，国联安基金管理有限公司高级产品经理，中原英石基金管理有限公司产品管理部副总监。

### 3、公司高级管理人员

汤海涛先生，董事长。中共党员，经济及管理学硕士。具有证券投资基金从业资格。曾任交通银行股份有限公司哈尔滨分行核算运行中心副主任、会计结算部高级经理，交通银行股份有限公司大庆分行党委书记、行长；太平资产管理有限公司市场部总经理、北方项目事业部总经理、产品开发部总经理；太平养老保险股份有限公司投资总监等职。现任太平资产管理有限公司党委委员、副总经理，本基金管理人董事长。

邱宏斌先生，总经理。中共党员，经济学硕士。具有证券投资基金从业资格。曾任大连信托投资公司证券部投资经理、上海证券营业部总经理；大通证券股份有限公司营业部总经理、华东区总经理；泰信基金管理有限公司高级研究员、理财顾问部总经理；光大保德信基金管理有限公司专户理财部投资总监；泰信基金管理有限公司总经理助理兼专户投资总监；太平资产管理有限公司资产管理事业部总经理、产品开发部总经理、投资管理中心副总经理，太平基金管理有限公司副总经理等职。现任本基金管理人总经理。

王健先生，督察长。中共党员，经济学硕士，高级会计师。具有证券投资基金从业资格。曾任河南证券有限责任公司计划财务处、稽查处副处长、处长，中原证券股份有限公司资产保全总部、法律事务总部、合规管理总部总经理，中原英石基金管理有限公司筹备组常务副组长，中原英石基金管理有限公司督察长等职务。现任本基金管理人督察长。

吴东先生，副总经理。中共党员，政治学理论硕士，具有证券投资基金从业资格、仲裁员资格、律师资格。曾任上海市司法局办公室副主任；中国人寿保险

股份有限公司上海分公司内控合规部总经理；中国人寿保险股份有限公司上海分公司宝山支公司总经理；太平资产管理有限公司风险管理部/项目评审部副总经理（部门总经理级）、监察部总经理、风险管理及合规部总经理等职。现任本基金管理人副总经理。

金芳女士，副总经理。工商管理硕士。具有证券投资基金从业资格。曾任中国对外贸易信托投资公司项目经理及上海证券自营业务负责人，中国化工进出口公司总裁办公室秘书，中宏人寿投资部助理总经理（主持工作），太平人寿投资部副总经理兼投委会秘书，太平资管运营保障部副总经理、市场服务部总经理、金融市场事业部总经理。现任本基金管理人副总经理。

宋卫华先生，副总经理。中共党员，数量经济学硕士。具有证券投资基金从业资格。曾任河南省驻马店市第三中学教师，东北财经大学数量经济研究所助理研究员，河南财政证券公司期货部业务主管、总经理助理兼投资部经理，中原证券股份有限公司证券投资总部副总经理、上海大连西路营业部副总经理、研究所副所长等职务，中原英石基金管理有限公司副总经理。现任本基金管理人副总经理。

岳冲先生，副总经理。中共党员，法律硕士。曾任职于中国海关、中国证监会。现任本基金管理人副总经理。

#### 4、本基金基金经理

##### （1）现任基金经理

林开盛先生，上海财经大学金融学专业证券投资方向硕士。具有证券投资基金从业资格。10年证券基金行业从业经验。2009年7月至2016年4月在申银万国证券研究所任首席分析师，精通化工行业分析。2016年4月加入本公司任研究发展部负责人，从事投资研究相关工作。2017年5月9日起任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。2019年3月25日任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。徐磊先生，英国埃塞克斯大学金融学博士，经济学硕士，南开大学金融学



本科。CFA、FRM。8年海内外证券投资基金行业从业经验。其中海外投资经验2年。2016年4月加入本公司，现任量化投资部负责人。曾在花旗私人银行（欧非中东总部，伦敦）和Kleinwort Benson私人银行（伦敦）从事全球资产配置量化研究工作，涵盖美国，欧洲，亚洲等市场，包括香港的股票市场，回国后先后在中原英石基金和嘉合基金任量化研究员和投资经理。2019年1月29日起担任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

## （2）过往基金经理

赵梓峰先生，任职期间：2015年2月10日至2016年3月17日。

翁锡赉先生，任职期间：2016年3月8日至2017年5月9日。

独孤南薰先生，任职时间：2016年4月7日至2018年9月7日。

## 5、投资决策委员会成员的姓名、职务

本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

投资决策委员会主席：总经理邱宏斌先生。

投资决策委员会成员：总经理助理宋磊先生、权益投资部负责人兼基金经理梁鹏先生、量化投资部负责人兼基金经理徐磊先生、研究发展部负责人兼基金经理林开盛先生、资深研究员魏志羽先生、固定收益部负责人陈晓。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 三、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路154号

办公地址：上海市银城路167号

法定代表人：高建平

成立时间：1988年8月26日

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74号

电话：021-52629999-212188

联系人：黄明阳

## （二）发展概况及财务状况

兴业银行成立于1988年8月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本207.74亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2018年12月31日，兴业银行资产总额达6.71万亿元，实现营业收入1582.87亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润606.20亿元。

## （三）资产托管业务的机构设置

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理及产品研发处、养老金管理中心等处室，共有员工100余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

## （四）托管业务情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号。截至2019年6月30日，兴业银行共托管证券投资基金267只，托管基金的基金资产净值合计10468.1亿元，基金份额合计10311.43亿份。

# 四、相关服务机构

## （一）基金份额销售机构

## 1、直销机构

名称：太平基金管理有限公司

住所：中国上海市虹口区邯郸路135号5幢101室

办公地址：中国上海浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室

法定代表人：汤海涛

联系人：杨蕾

客户服务电话：021-61560999

传真：021-38556751

公司网址：www.taipingfund.com.cn

## 2、其他销售机构

### （1）交通银行股份有限公司

住所：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：张作伟

联系电话：021-58781234-1740

传真：:021-58408836

客户服务电话：95559

网址：<http://www.bankcomm.com/>

### （2）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：福州市湖东路268号

法定代表人：兰荣

联系人：吴嘉虹

联系电话：021-38565570

传真：0591-38507538

客户服务电话：95562

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

(3) 中原证券股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务外环路10号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号

法定代表人：菅明军

联系人：张翼

联系电话：0371-65585662

传真：0371-65585665

客户服务电话：0371-967218、400-813-9666

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

(4) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

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：陈有安

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

传真：010-66568990

客户服务电话：400-888-8888

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

（5）海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路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：赖奕欣

联系电话：021-23219381

客服电话：95553、4008888001

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

（6）上海天天基金销售有限公司

住所：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3号楼c座7楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客户服务电话：400-181-8188

网址：www.1234567.com.cn

（7）上海联泰基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区金钟路658弄2号楼b座6楼

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

联系电话：021-52822063

传真：021-52975270

客户服务电话：4000-466-788

网址：www.66zichan.com

（8）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6楼？

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

联系电话：0571-81137494

客户服务电话：400-0766-123

网址：www.fund123.cn

（9）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市浦东新区峨山路91弄61号1幢12层（陆家嘴软件园10号楼）

法定代表人：李兴春

联系人：赵沛然

电话：021-50583533

传真：021-50583535

客户服务电话：400-0676-266

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

（10）诺亚正行基金销售有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场b座12f

法定代表人：汪静波

联系人：张裕

电话：021-38509735

传真：021-38509777

客户服务电话：400-8215-399

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

（11）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：杭州市文二西路1号903室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：费超超

电话：0571-88911818-8001

传真：0571-86800423

客户服务电话：400-8773-772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（12）大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室

办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼

法定代表人：袁顾明

联系人：何庭宇

电话：13917225742

传真：021-22268089

客户服务电话：400-9282-266、021-22267995

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

（13）上海陆金所基金销售有限公司

住所：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



联系电话：021-20665952

传真：021-22066653

客户服务电话：400-8219-031

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

（14）上海汇付基金销售有限公司

住所：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

办公地址：上海市黄浦区中山南路100号19层

法定代表人：冯修敏

联系人：周丹

联系电话：021-33323999

传真：021-33323993

客户服务电话：400-8202-819

网址：<https://tty.chinapnr.com>

（15）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地点：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：（021）58870011

传真：（021）68596916

客户服务电话：4007009665

网址：www.HowBuy.com

（16）珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路6号105 室-3491

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  
B1201-1203

法人代表：肖雯

联系人：曾健灿

联系电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户服务电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

（17）北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市北京经济技术开发区宏达北路10 号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路20 号乐成中心A座23层

法定代表人：梁越

联系人：张晔

联系电话：010-56810307

传真：010-57756199

客户服务电话：4008980618

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

(18) 上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

联系电话：021-51327185

传真：021-50710161

客户服务电话：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(19) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

联系电话：010-56282140

传真：010-62680827

客户服务电话：400-619-9059

网址：<http://www.fundzone.cn>

(20) 上海凯石财富基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号4楼

法定代表人：陈继武

联系人：王哲宇

联系电话：021-63333389

传真：021-63333390

客户服务电话：4006-433-389

网址：<https://www.lingxianfund.com/>

（21）乾道盈泰基金销售（北京）有限公司

住所：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室

法定代表人：王兴吉

联系人：高雪超

联系电话：010-62062880

传真：010-82057741

客户服务电话：4000888080

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

（22）北京肯特瑞基金销售有限公司

注所：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层

法定代表人：江卉

联系人：徐伯宇

联系电话：4000988511/ 4000888816

传真：010-89188000

客户服务电话：95118

网址：fund.jd.com

（23）上海长量基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张跃伟

联系人：黄辉

联系电话：021-20691869

传真：021-20691861

客户服务电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

（24）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层

法定代表人：张彦

联系人：文雯

联系电话：010-83363101

传真：010-83363072

客户服务电话：400-116-1188

网址：8.jrj.com.cn

（25）南京苏宁基金销售股份有限公司

住所：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：钱燕飞

联系人：赵耶

联系电话：18551602256

传真：025-66008800-884131

客户服务电话：95177

网址：www.snjijin.com

（26）上海基煜基金销售有限公司

住所：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

联系电话：021-65370077-220

传真：021-55085991

客户服务电话：021-65370077

网址：<https://www.jiyufund.com.cn/>

（27）北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人：钟斐斐

联系人：侯芳芳

联系电话：010-61840688

传真：010-61840699

客户服务电话：400-159-9288

网址：<https://danjuanapp.com/>

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

（二）登记机构

名称：太平基金管理有限公司

住所：中国上海市虹口区邯郸路135号5幢101室

办公地址：中国上海浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室

法定代表人：汤海涛

联系人：孙波

联系电话：021-38556708

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市海华永泰律师事务所  
住所：上海市华阳路112号2号楼东虹桥法律服务园区302室  
办公地址：上海市东方路69号裕景国际商务广场A楼15层  
负责人：张诚  
经办律师：沈国勇、张兰  
联系人：张兰  
联系电话：021-5877 3177  
传真：021-5877 3268

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼  
执行事务合伙人：李丹  
签章注册会计师：都晓燕  
联系人：都晓燕  
联系电话：021-23238888  
传真：021-23238800

## 五、基金的名称

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

## 六、基金的类型

混合型证券投资基金

## 七、基金份额的申购与赎回

### （一）基金的申购费与赎回费及其用途

#### 1、申购费率

本基金的申购费率随申购金额的增加而递减，申购费率按申购金额进行分档。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。如下表所示：



申购金额（M，含申购费）	申购费率
M<50万	1.5%
50万≤M<200万	1.0%
200万≤M<500万	0.6%
M≥500万	按笔收取，1000 元/笔

（注：M：申购金额；单位：元）

本基金的申购费用由投资人承担，在投资人申购基金份额时收取。主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

## 2、本基金的赎回费率随着持续持有期的增加而递减

持续持有期（P）	赎回费率
P<7 日	1.5%
7日≤P<30日	0.75%
30日≤P<1年	0.5%
1年≤P<2年	0.25%
P≥2年	0

注：1 年指 365 天

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

对持续持有期少于 30 日的投资人，将赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于 3 个月的投资人将赎回费总额的 75%计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人，将赎回费总额的 50%计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，应当将赎回费总额的 25%计入基金财产。

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购

费率和基金赎回费率。

## （二）申购份额与赎回金额的计算

### 1、本基金申购份额的计算：

本基金申购采用金额申购的方式，申购费率按申购金额进行分档。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

例：某投资人投资 10,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.050 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.5\%) = 9,852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,852.22 = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,852.22 / 1.050 = 9,383.07 \text{ 份}$$

即：投资人投资 10,000 元申购本基金，对应申购费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.050 元，则可得到 9,383.07 份基金份额。

### 2、本基金赎回金额的计算：

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

例：某投资者赎回 10 万份基金份额，份额持有期限 40 天，对应赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.213 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 100,000 \times 1.213 = 121,300.00 \text{ 元}$$

赎回费用=121,300.00×0.5% = 606.50 元

净赎回金额=121,300.00－606.50=120,693.50 元

即：投资者赎回本基金 10 万份基金份额，份额持有期限 40 天，假设赎回当日基金份额净值是 1.213 元，则其可得到的净赎回金额为 120,693.50 元。

### 3、本基金基金份额净值的计算：

计算日基金份额净值=计算日基金份额的基金资产净值/计算日基金份额余额总数

本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### 4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

### 5、赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

## （三）基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## （四）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## 八、基金的投资目标

本基金通过优化资产配置和灵活运用多种投资策略，寻找推动经济增长的内在动力，精选具有较高成长性和投资价值的金融工具，在充分控制投资风险的基础上，力争实现持续稳定的投资回报。

## 九、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、可转换债券、银行存款和债券等资产，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相关规定）。

固定收益类资产包括通知存款、银行定期存款、协议存款、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购等。

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。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，固定收益类资产投资占基金资产的比例为 5%-100%，扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

## 十、基金的投资策略

### （一）投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金采用自上而下的多因素分析方法进行宏观策略研究，对宏观经济方面重大问题、突发事件、重大政策进行及时研究与评估，对影响证券市场的相关因

素（政策、资金、利率走向、行业比较、上市公司盈利增长预期、估值水平、市场心理等）进行综合考量，分析和预测证券市场走势和行业热点，预测权益类资产和固定收益类资产的风险收益特征，确定中长期的资产配置方案。在公司投资决策委员会的统一指导下进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、股指期货等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险并提高收益。

## 2、股票投资策略

本基金采用灵活的股票投资策略，充分挖掘中国经济结构调整和产业升级衍伸的投资机会，关注具有持续高成长性的行业和上市公司，以分享经济增长带来的投资回报。

### （1）成长精选策略

本基金通过借鉴国际经济和产业发展路径，把握中国经济增长结构以及推动经济增长的内在动力，深入挖掘其内在驱动因素。本基金将综合考虑经济结构转型、产业结构升级、技术创新发展、国家政策支持等多元化的投资机会，重点关注符合国际经济发展趋势和国内经济结构转型的、具备持续成长动力和成长空间的行业或产业中的优质上市公司，如具有重大技术突破和重大发展需求的新兴产业；具有高技术含量、高附加值、占据产业链核心位置的高端装备制造业；具有持续高成长性的消费类行业、医药医疗类行业等。本基金在深入分析和充分论证的基础上评估对资本市场的影响方向和力度，并根据市场趋势和特点进行动态调整，以获取持续性、高成长带来的投资回报。

### （2）个股精选策略

#### 1) 公司质量评估

在充分行业评估基础上，深入调研上市公司，基于公司治理、公司发展战略、基本面变化、竞争优势、管理水平、估值比较和行业景气度趋势等关键因素，评估中长期发展前景，重点关注上市公司的成长性和核心竞争力。

从以下几个方面进行分析：

公司所处行业前景：公司所处行业具有良好的发展趋势和高成长性；行业规模、行业景气周期、增长速度、相对竞争格局等方面有利于公司业务扩展、利润

增长、可持续性成长。

**公司核心竞争力：**公司在生产、技术、市场、创新、资源、品牌等一个或多个方面占据领先地位或具有显著的潜在成长性，能够在行业中具备竞争优势。

**公司盈利能力：**公司具有良好的财务结构、资产状况、盈利指标、偿债能力、成本控制能力、现金流特征，公司发展具有可持续性和稳定性。

**公司治理结构：**公司管理层结构稳定、高效，具有良好的战略规划、实施、调整能力等。

## 2) 价值评估

本基金将结合市场阶段特点及行业特点,选取相关的相对估值指标(如 P/B、P/E、EV/EBITDA、PEG、PS 等)和绝对估值指标(如 DCF、NAV、FCFF、DDM、EVA 等)对上市公司进行估值分析,精选财务健康、具备成长性、估值合理的股票。

## 3) 新股申购策略

本基金将研究首次公开发行股票或增发新股的上市公司基本面因素,根据股票市场整体定价水平,估计新股上市交易的合理价格,同时参考一级市场资金供求关系,制定相应的新股申购策略。

本基金还将结合研究员的实地调查研究,并按照投资决策程序,构建本基金的股票投资组合并进行动态调整。

## 3、债券投资策略

本基金债券投资策略主要包括久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略等。

### (1) 久期策略

本基金将对宏观经济状况和货币政策等因素进行分析,形成对未来市场利率变动方向的预期,并根据本基金债券投资的风险收益要求,确定债券组合的久期配置。

### (2) 收益率曲线策略

本基金将评估均衡收益率水平,通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比,确定合理的组合期限结构并采用相应策略,如子弹策略、杠铃策略、梯式策略等,在不同期限的债券之间进行动态调整。

### （3）类别选择策略

本基金通过分析宏观经济状况、货币政策、市场供求等因素，评估各券种的相对投资价值，在各种固定收益品种之间进行优化配置，以获取不同类型品种之间利差变化所带来的投资收益。

### （4）个券选择策略

本基金在有效控制组合风险的基础上，分析信用风险、流动性、税赋水平等因素，挖掘定价合理或价值被市场低估的品种，以获取超额收益。

对于中小企业私募债券，本基金通过分析发行人财务状况、经营状况、所处行业、增信措施等因素，结合基金资产流动性的需要，在充分考虑信用风险、流动性风险的基础上，进行审慎投资，严格控制中小企业私募债券的投资风险。

### （5）可转换债券投资策略

可转换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和转换期权价值，本基金将对可转换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资。

### （6）中小企业私募债投资策略

本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的类属和个券，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。

## 4、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货投资。本基金通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，对股指期货合约进行估值定价，并与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作。

## 5、权证投资策略

本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下将投资权证。

本基金的权证投资，是在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，投资于合理内在价值的权证

品种。

#### （四）投资决策依据和决策程序

为了使大类资产配置方案得以顺利贯彻实施，并提升配置效率，本基金遵循以下投资决策依据以及具体的决策程序：

##### 1、投资决策依据

- （1）须符合有关法律、法规和基金合同的规定；
- （2）以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则；
- （3）国内宏观经济发展态势、货币市场运行环境、政策指向及全球经济因素分析。

##### 2、决策程序

（1）投资研究团队为投资决策委员会、投资总监和基金经理提供投资决策依据，包括宏观经济研究、行业研究、投资品种研究报告等；

（2）投资决策委员会是公司基金投资的最高决策机构，负责对公司所管理基金投资中的重大问题进行决策。

投资决策委员会根据公司投资研究团队提交的研究报告，对宏观经济形势和市场的走势做出分析判断，并根据现行法律、法规和基金合同的有关规定，制定投资策略、投资目标和总体计划，决定基金资产的配置比例等，对基金经理和投资总监做出投资授权，对超出基金经理或投资总监权限的投资项目做出决定，对基金经理的投资活动进行监督和管理；

（3）投资总监在投资决策委员会的授权范围内组织安排投资工作，贯彻落实投资决策委员会的各项投资决策和投资计划，对工作中的问题进行协调、反馈、调整、评估，检查监督基金经理执行投资决策委员会决议的情况和基金经理的日常投资运作；

（4）基金经理遵照投资决策委员会制定的基金资产配置方案的意见，确定基金投资的配置方案，寻求最佳的投资机会和选择最佳的投资对象，将投资指令下达至交易部的交易员执行。

（5）交易部接到基金经理下达的交易指令后将准确及时地予以执行，并及时反馈情况。每个交易日交易结束后，基金会计根据交易所回馈信息进行基金清算。



(6) 风险控制委员会和稽核风控部门监督和检查投资决策方案的制定、实施和执行的整个投资运作流程，并提出基金业绩评估报告和风险控制建议。

#### (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) 本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，固定收益类资产投资占基金资产的比例为 5%-100%；

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，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%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(15) 本基金在任何交易日日终，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%；

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 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；

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

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

(18) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的 0% - 95%；

(19) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

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

(21) 本基金总资产不超过基金净资产的 140%；

(22) 本基金管理人管理的全部开放式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%；

(23) 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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新

增流动性受限资产的投资；

(24) 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；

(25) 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)、(23)、(24)项外，因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。在该期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，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，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合中国证监会的规定，必须事先得到基金

托管人的同意，并履行信息披露义务。

法律法规或监管部门调整上述规定的，本基金的投资按照调整后的规定执行。

#### （六）基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

### 十一、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：1年期银行定期存款利率（税后）+2%

其中，1年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布的金融机构1年期人民币存款基准利率。

未来，如中国人民银行调整或停止发布基准利率，或市场有其他更适合本基金的基准时，本基金管理人可根据具体情况，与基金托管人协商一致后，对业绩比较基准进行相应调整并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

### 十二、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

### 十三、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——兴业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6月30日，本报告中财务资料未经审

计。

**1、报告期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	569,998,659.86	36.52
	其中：股票	569,998,659.86	36.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	173,055,000.00	11.09
	其中：债券	173,055,000.00	11.09
	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	400,000,000.00	25.63
	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	410,125,915.35	26.28
8	其他资产	7,711,469.02	0.49
9	合计	1,560,891,044.23	100.00

**2、报告期末按行业分类的股票投资组合**

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	1,784,773.25	0.12
C	制造业	431,110,007.21	29.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,703,200.00	0.12
E	建筑业	32,391,017.20	2.21
F	批发和零售业	3,549,670.80	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	13,851,914.00	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,645,534.36	2.16
J	金融业	14,157,533.94	0.97

K	房地产业	5,157,097.00	0.35
L	租赁和商务服务业	34,502,130.10	2.35
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	145,782.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	569,998,659.86	38.87

### 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投资股票。

### 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	600352	浙江龙盛	2,563,796	40,431,062.92	2.76
2	000651	格力电器	569,908	31,344,940.00	2.14
3	002384	东山精密	2,130,000	31,034,100.00	2.12
4	600887	伊利股份	900,000	30,069,000.00	2.05
5	600284	浦东建设	3,799,906	29,259,276.20	2.00
6	002035	华帝股份	2,398,679	29,215,910.22	1.99
7	601888	中国国旅	315,674	27,984,500.10	1.91
8	600216	浙江医药	2,199,847	22,526,433.28	1.54
9	002353	杰瑞股份	939,917	21,712,082.70	1.48
10	300601	康泰生物	399,940	20,996,850.00	1.43

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	142,596,000.00	9.72
	其中：政策性金融债	142,596,000.00	9.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,459,000.00	2.08
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	173,055,000.00	11.80

#### 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	140203	14 国开 03	600,000	62,436,000.00	4.26
2	180209	18 国开 09	600,000	60,018,000.00	4.09
3	101468005	14 中铝业 MTN001	300,000	30,459,000.00	2.08
4	150402	15 农发 02	200,000	20,142,000.00	1.37

#### 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。

## 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。

## 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。

## 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### （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。

### （2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### （1）本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

### （2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

### （3）本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

## 11、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体或其分支机构中，苏州东山精密制造股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述情形外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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。

（2）本报告期内，本基金投资的前十名股票中没有出现超出基金合同规定备选股票库的情形。

### （3）其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	2,357,546.69



2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,353,722.63
5	应收申购款	199.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,711,469.02

**(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。

**(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中未有流通受限情况。

**十四、 基金的业绩**

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金招募说明书。

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016年1月1日至2016年12月31日	-16.05%	0.78%	3.57%	0.01%	-19.62%	0.77%
2017年1月1日至2017年12月31日	13.96%	0.52%	3.56%	0.01%	10.40%	0.51%
2018年1月1日至2018年12月31日	-17.71%	0.73%	3.56%	0.01%	-21.27%	0.67%

2019年1月1日至2019年6月30日	11.00%	0.84%	1.75%	0.01%	9.25%	0.83%
自基金合同生效日起至2015年12月31日	-21.50%	1.96%	3.65%	0.01%	-25.15%	1.95%
自基金合同生效日起至2016年12月31日	-34.10%	1.46%	7.35%	0.01%	-41.45%	1.45%
自基金合同生效日起至2017年12月31日	-24.90%	1.22%	11.18%	0.01%	-36.08%	1.21%
自基金合同生效日起至2018年12月31日	-38.20%	1.11%	15.14%	0.01%	-53.34%	1.10%
自基金合同生效日起至2019年6月30日	-31.40%	1.08%	17.16%	0.01%	-48.56%	1.07%

注：本基金成立于 2015 年 2 月 10 日。

## 十五、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、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，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 3 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 0.25% 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，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 3 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。

上述“一、基金费用的种类中第 3—8 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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十六、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金管理人于 2019 年 3 月 26 日刊登的本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、对“重要提示”部分的内容进行了更新。
- 2、对“第三部分 基金管理人”的内容进行了更新。
- 3、对“第四部分 基金托管人”的内容进行了更新。
- 4、对“第五部分 相关服务机构”的内容进行了更新。
- 5、对“第九部分 基金的投资”的内容进行了更新。
- 6、对“第十部分 基金的业绩”的内容进行了更新。
- 7、对“第二十二部分 其他应披露事项”的内容进行了更新。

太平基金管理有限公司

二〇一九年九月二十三日