

# 平安双债添益债券型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

截止日期： 2019 年 12 月

## 重要提示

平安双债添益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2018年2月9日证监许可[2018]306号文注册。本基金基金合同于2018年6月4日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。

本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购/申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金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本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的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。

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，基金经理相关信息更新截止日为2019年12月5日，除上述

事项外本招募说明书所载内容截止日期为2019年6月3日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期2019年3月31日。

本招募说明书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。

## 第一部分 基金管理人

### （一）基金管理人概况

#### 1、基本情况

名称：平安基金管理有限公司

注册地址：深圳福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 楼

办公地址：深圳福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 楼

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	14.30%
合计	130,000	100%

基金管理人无重大行政处罚记录。

#### 3、客服电话：400-800-4800（免长途话费）

### （二）基金管理人主要人员情况

#### 1、董事、监事及高级管理人员

##### （1）董事会成员

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

安人寿总公司人事行政部/培训部总经理、平安保险集团品牌宣传部总经理、平安人寿北京分公司总经理、平安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汇通投资管理有限公司执行董事。

姚波先生，董事，硕士，1971年生。曾任 R.J.Michalski Inc.（美国）养老金咨询分析员、Guardian Life Ins.Co（美国）助理精算师、Swiss Re（美国）精算师、Deloitte Actuarial Consulting Ltd.（香港）精算师、中国平安保险（集团）股份有限公司副总精算师、总经理助理等职务，现任中国平安保险（集团）股份有限公司常务副总经理兼首席财务官兼总精算师。

陈敬达先生，董事，硕士，1948年生，新加坡。曾任香港罗兵咸会计师事务所审计师；新鸿基证券有限公司执行董事；DBS 唯高达香港有限公司执行董事；平安证券有限责任公司副总经理；平安证券有限责任公司副董事长/副总经理；平安证券有限责任公司董事长；中国平安保险（集团）执行委员会执行顾问，现任集团投资管理委员会副主任。

肖宇鹏先生，董事，学士，1970年生。曾任职于中国证监会系统、平安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，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，同时兼任瑞士德科集团顾问、崇侨托管（香港）有限公司董事、数码通电讯集团独立非执行董事、United Investments Private Ltd 董事、United Orient Capital G.P. Ltd 董事、大华银行托管（香港）有限公司董事、United Pte Equity Investments (Cayman) Ltd 董事、新加坡大华亚洲（香港）有限公司董事、大华投资管理（上海）有限公司董事。

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。

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。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）公司高级管理人员

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汇通投资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。

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

WANG AO 先生，澳大利亚籍，CAIA、FRM，CFA，澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士。曾任职原深发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012年9月加入平安基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益研究员。现任平安鑫享混合型证券投资基金（2016-09-05至今）、平安惠金定期开放债券型证券投资基金（2016-11-02至今）、平安添利债券型证券投资基金（2017-12-01至今）、平安双债添益债券型证券投资基金（2018-06-04至今）、平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金（2018-10-17至今）、平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金（2019-06-12至今）、平安可转债债券型证券投资基金（2019-08-07至今）基金经理。

WANG AO 先生曾管理的基金名称及管理时间：平安财富宝货币市场基金（2015-11-04至2016-11-25）、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金（2016-12-07至2018-11-22）、平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金（2018-03-16至2019-04-22）。

### 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，北京大学经济学硕士，曾先后担任国信证券股份有限公司经济研究所分析师、华宝兴业基金管理有限公司研究部分析师、嘉实基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理。2018年3月加入平安基金管理有限公司，现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净值信息，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、足额支付赎回款项；
- 15、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- 17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
- 18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21、监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
- 23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他

法律行为；

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

#### （四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或职务便利为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

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

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

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

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金持有人或其它基金相关机构的合法权益；

（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其它股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其它法律、行政法规禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于禁止行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，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。

#### 5、基金经理承诺

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

(2) 不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易，不利用职务之便为自己、或任何第三者谋取利益；

(3) 不违反现行有效的法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (五) 基金管理人的内部风险控制制度

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

##### 1、公司内部控制的总体目标

- (1) 保证公司经营管理活动的合法合规性；
- (2) 保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；
- (3) 实现公司稳健、持续发展，维护股东权益；
- (4) 促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责；
- (5) 保护公司最重要的资本：公司声誉。

##### 2、公司内部控制遵循的原则

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位职员；

(2) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(3) 相互制约原则：公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡；

(4) 独立性原则：公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位；

公司内部部门和岗位的设置必须权责分明；

(5) 有效性原则：各种内部管理制度具有高度的权威性，应是所有员工严格遵守的行动指南；执行内部管理制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

(6) 适时性原则：内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

(7) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，力争以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果；

(8) 防火墙原则：公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离。

### 3、内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的纲要和总揽；第二个层面是公司基本管理制度，包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度；第三个层面是部门业务规章，是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明；第四个层面是业务操作手册，是各项具体业务和管理工作的运行办法，是对业务各个细节、流程进行的描述和约束。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

### 4、关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

#### (1) 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻

执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

#### （2）公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

#### （3）基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

#### （4）交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；应建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；集中交易室应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时应建立科学的投资交易绩效评价体系。

#### （5）基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

#### （6）信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

#### (7) 监察稽核

公司设立督察长，经董事会聘任，报中国证监会相关机构认可。根据公司监察稽核工作的需要，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立法律合规监察部开展监察稽核工作，并保证法律合规监察部的独立性和权威性。公司明确了法律合规监察部及内部各岗位的具体职责，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

法律合规监察部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，促使公司各项经营管理活动的规范运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

### 5、基金管理人关于内部控制制度声明书

- (1) 基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 基金管理人承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。



## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基金托管人基本情况

名称：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

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 34,932,123.46 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

#### 2、主要人员情况

截至 2018 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 202 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

#### 3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2018 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 923 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港

《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 64 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017、2018共十二次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随

随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

### 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

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 第三部分 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

平安基金管理有限公司

办公地址：深圳福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 楼

法定代表人：罗春风

直销电话：0755-22627627

直销传真：0755-23990088

联系人：郑权

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

#### 2、代销机构

##### 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) 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/>

5) 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)

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](http://www.csc108.com)

7) 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)

8) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

客服电话：400-8888-888/95551

传真：010-83574807

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

9) 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

10) 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

11) 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

12) 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

13) 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)

14) 中信证券（山东）有限责任公司

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

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

法定代表人：姜晓林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：0532-96577

传真：0532-85022605

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

15) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081493

客服电话：95321

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

16) 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

17) 东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市自由大路 1138 号

办公地址：吉林省长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

客服电话：95360

传真：0431-85096795

网址：www.nesc.cn

18) 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

19) 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

20) 国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

法定代表人：姚志勇

联系人：沈刚

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

客服电话：95570

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

21) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7 楼

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7 楼

法定代表人：吴承根

联系人：陈姗

联系电话：021-80108643

客服电话：967777

传真：0571-87902090

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

22) 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)

23) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105

传真：010-88085195

客服电话：4008000562

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

24) 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)

25) 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](http://www.firstcapital.com.cn)

26) 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](http://www.cicc.com.cn)

27) 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)

28) 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>

29) 开源证券股份有限公司

注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

联系人：袁伟涛

电话：029-63387289

传真：029-81887060

客服电话：400-860-8866

网址：[www.kysec.cn](http://www.kysec.cn)

30) 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 15 楼

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

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

31) 中信期货有限公司

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

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

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

电话：010-6083 3754

传真：010-5776 2999

客服电话：400-990-8826

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

32) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

邮政编码：518000

法定代表人：姜昧军

联系人：王雯

客服电话：4008-323-000

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

## 33) 民商基金销售(上海)有限公司

注册地址：上海黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

联系人：杨一新

电话：021-50206003

传真：021-50206001

客服电话：021-50206003

公司网站 <http://www.msftec.com>

## 34) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

邮政编码：230081

法定代表人：李工

联系人：范超

客服电话：95318

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

## 35) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市宣武门外大街甲 1 号新华社三工作区 5F

法定代表人：钱昊旻

联系人：徐英

电话：010-59336539

传真：010-59336500

客服电话：4008909998

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

## 36) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 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 6F

法定代表人：祖国明



联系人：韩爱彬

电话：021-60897840

传真：0571-26697013

客服电话：400-766-123

网址：www.fund123.cn

37) 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：张琦

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

38) 京东金融-北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院八座 15 层

法定代表人：江卉

联系人：娄云

电话：4000888816

客服电话：95118

网址：<http://fund.jd.com>

39) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦

法定代表人：陈继武

联系人：高浩辉

联系电话：021-63333389

客服电话：400 643 3389

网址：<https://www.vstonewealth.com/>

40) 弘业期货股份有限公司

注册地址：南京市中华路 50 号

办公地址：南京市中华路 50 号

法定代表人：周剑秋

联系人：郭晓蓉

电话：025-68509525

传真：025-52313068

客服电话：400-828-1288

网址：<http://www.ftol.com.cn/etrading>

41) 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)

42) 上海陆享基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇广场二座 16 层

法定代表人：陈志英

联系人：唐京莎

电话：021-53398816

网址：<http://www.luxxfund.com/>

43) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：江苏省南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室

法定代表人：吴言林

电话：025-66046166 转 837

传真：025-56663409

联系人：孙平

客户服务热线：025-66046166

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

44) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：张燕

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

客服电话：95555

网址：<http://www.cmbchina.com>

45) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼

法定代表人：徐丽峰

联系人：占文驰

联系电话：0791-86283372

客服电话：4008 222 111

网址：<https://www.gszq.com/>

46) 中民财富基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层 05 单元

法定代表人：弭洪军

联系人：黄鹏

电话：021-33355333

传真：021-63353736

客服电话：400-876-5716

网址：www.cmiwm.com

## 二、基金登记机构

平安基金管理有限公司

注册地址：深圳福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 楼

办公地址：深圳福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 楼

法定代表人：罗春风

电话：0755-22624581

传真：0755-23990088

联系人：张平

## 三、律师事务所和经办律师

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、会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11

楼

法定代表人：李丹

联系电话：（021）2323 8888

传真电话：（021）2323 8800

经办注册会计师：曹翠丽、邓昭君

联系人：邓昭君

## 第四部分 基金的名称

平安双债添益债券型证券投资基金

## 第五部分 基金的类型

债券型证券投资基金

## 第六部分 基金的运作方式

契约型开放式

## 第七部分 基金的投资

### （一）投资目标

本基金通过对可转债和信用债的积极投资，在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市交易的债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债券、证券公司短期公司债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、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、现金等货币市场工具、国债期货等，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。

本基金不直接买入股票、权证等权益类资产，但可持有因可转债、可交换债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证，本基金应在可交易之日起 10 个交易日内卖出。

本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券及信用债的比例合计不低于非现金基金资产的 80%；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，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

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

如果法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种或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，可以将其纳入投资范围或可以调整上述投资品种的投资比例。

### （三）投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金将密切关注经济运行趋势，把握领先指标，预测未来走势，深入分析国家推行的财政与货币政策对未来宏观经济运行以及投资环境的影响。本基金将根据宏观经济、基准利率水平，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，做出最佳的资产配置及风险控制。

## 2、信用债投资策略

本基金将重点投资信用类债券，以提高组合收益能力。本基金所指信用债券是指企业债券、公司债券、短期融资券、金融债券（不包括政策性金融债）、次级债、可转换债券等非国家信用的固定收益类金融工具。

信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源，本基金将在公司内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下，积极投资信用债券，获取信用利差带来的高投资收益。

债券的信用利差主要受两个方面的影响，一是市场信用利差曲线的走势；二是债券本身的信用变化。本基金依靠对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等分析，判断市场信用利差曲线整体及分行业走势，确定各期限、各类属信用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资，减持信用利差被低估、未来信用利差可能上升的信用债券。

## 3、可转债及可交换债投资策略

本基金投资于可转债债券、可分离交易可转债、可交换债券以及其他含权债券等，该类债券赋予债券投资者某种期权，比普通债券投资更加灵活。本基金将综合研究此类含权债券的债券价值和权益价值，债券价值方面综合考虑票面利率、久期、信用资质、发行主体财务状况及公司治理等因素；权益价值方面仔细开展对含权债券所对应个股的价值分析，包括估值水平、盈利能力及未来盈利预期，此外还需结合对含权条款的研究综合判断内含期权的价值。本基金力争在市场低估该类债券价值时买入并持有，以期在未来获取超额收益。

### （1）可转换债券投资策略

可转换债券即可转换公司债券，是指在规定的期限内持有人有权按照约定的



价格将债券转换成发行人的股票的一种含权债券，如果转换并非有利，持有人可选择持有债券至到期，因此该类型债券兼具债性和股性。债性是指投资者可以选择持有可转换债券至到期以获取票面价值和票面利息；股性是指投资者可以在转股期间以约定的转股价格将可转换债券转换成发行人的股票。投资该类型债券的子策略包括：

1) 个券精选策略。针对可转换债券的股性，本基金将通过成长性指标（预期主营业务收入增长率、净利润增长率、PEG）、相对价值指标（P/E、P/B、P/CF、EV/EBITDA）以及绝对估值指标（DCF）的定量评判，筛选出具有 GARP（合理价格成长）性质的正股。针对可转换债券的债性，本基金将结合可转换债券的信用评估以及正股的价值分析，作为个券的选择依据。

2) 条款价值发现策略。可转换债券通常设置一些特殊条款，包括修正转股价条款、回售条款和赎回条款等，这些条款在特定的环境下对可转换债券价值有较大影响。本基金将结合发行人的经营状况以及市场变化趋势，深入分析各项条款挖掘可转换债券的投资机会。

3) 套利策略。按照条款设计，可转换债券可根据事先约定的转股价格转换为发行人的股票，因此可转换债券和正股之间存在套利空间。当可转换债券的转股溢价率为负时，买入可转换债券并卖出股票获得价差收益。本基金将密切关注可转换债券与正股之间的关系，把握套利机会，增强基金投资组合收益。

#### （2）可分离交易可转债投资策略

可分离交易可转债与普通可转换债券的区别主要体现在分离交易可转债在上市后分离为纯债部分和权证部分，并分别独自进行交易。对于可分离交易可转债的纯债部分的投资按照普通债券投资策略进行管理。对于可分离交易可转债的权证部分可以结合其市价判断卖出或行使新股认购权。

#### （3）可交换债券投资策略

可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。可交换债券同样具有股性和债性，其中债性与可转换债券相同，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投

资决策。

#### 4、普通债券投资策略

##### (1) 利率预期策略与久期管理

本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对 GDP、CPI、PPI、外汇收支及国际市场流动性动态情况等引起利率变化的相关因素进行深入研究，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金及债券的供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。

当预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。以达到利用市场利率的波动和债券组合久期的调整提高债券组合收益率目的。

本基金根据对收益率曲线形状变动的预期建立或改变组合期限结构。通过预测收益率曲线变动的方向，然后根据收益率曲线形状变动的情景分析，构建组合的期限结构。具体来看，又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

1) 骑乘策略是基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整。当收益率曲线比较陡峭时，即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平相对较高的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑来获得资本利得收益。

2) 子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点，适用于收益率曲线较陡时；杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端，适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动；梯式策略是使投资组合中的债券久期均匀分布于收益率曲线，适用于收益率曲线水平移动。

##### (2) 类属配置策略

类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金将在利率预期分析及其久期配置范围确定的基础上，通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。

### （3）证券选择策略

根据发行人公司所在行业发展以及公司治理、财务状况等信息对债券发行人主体进行评级，在此基础上，进一步结合债券发行具体条款（主要是债券担保状况）对债券进行评级。根据信用债的评级，给予相应的信用风险溢价，与市场上的信用利差进行对比，发掘具备相对价值的个券。

### （4）息差策略

本基金可以通过债券回购融入和滚动短期资金作为杠杆，投资于收益率高于融资成本的其它获利机会，从而获得杠杆放大收益。本基金进入银行间同业市场进行债券回购的资金余额不超过基金净资产的 40%。

## 5、资产支持证券投资策略

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。

## 6、证券公司短期公司债券投资策略

本基金可根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。此外，由于证券公司短期公司债券整体流动性相对较差，本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资，保证本基金的流动性。

## 7、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，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债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国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债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、现金头寸管理

由于法律法规限制和开放式基金正常运作的需要，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，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。其主要用途包括：支付潜在赎回款项、计提管理费和托管费等各类费用的需求、支付交易费用。为有效控制现金留存的影响，基金管理人将采用积极的现金头寸管理手段。具体采用手段包括：

(1) 合理控制现金头寸：根据对申购、赎回、转换等业务和相关费用提留的预判，结合标的指数走势和成份股流动性进行合理的现金留存，最大限度降低现金的持有比例；

(2) 提升现金头寸收益：在法律法规或市场条件允许的前提下，通过现金权益化的方式降低现金拖累的影响。

### (四) 投资限制

#### 1、组合限制

(1) 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。其中，投资于可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券和信用债的比例合计不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 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，现金或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) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(10) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(11) 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%；

(12) 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%；

(13) 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；

(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进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 基金总资产不超过基金净资产的 140%；

(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%；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）不低于基金资产的 80%；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) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

保持一致；

(19) 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)、(13)、(17)、(18)项外，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。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规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其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进

行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，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

本基金的业绩比较基准是：

中证可转换债券指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%

业绩比较基准选择理由：

中证可转换债券指数的样本由沪深证券交易所上述的可转换债券组成，以反映国内市场可转换债券的总体表现。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选择是在中证全债指数样本的基础上，增加央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

本基金是债券型证券投资基金，主要投资于可转债和信用债，本基金对中证可转换债券指数、中证综合债券指数分别赋予 50% 的权重符合本基金的投资特性。

若未来法律法规发生变化，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，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并履行适当程序后，适当调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

#### （六）风险收益特征

从基金资产整体运作来看，本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

#### （七）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；

- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

### (八) 投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商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	103,661,084.21	90.13
	其中：债券	103,661,084.21	90.13
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,661,508.70	3.18
8	其他资产	7,691,735.40	6.69
9	合计	115,014,328.31	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

本基金本报告期末未持有股票。



### 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

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,005,000.00	8.96
	其中：政策性金融债	5,000,500.00	4.48
4	企业债券	22,679,000.00	20.30
5	企业短期融资券	15,096,400.00	13.51
6	中期票据	39,146,950.00	35.04
7	可转债（可交换债）	16,733,734.21	14.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	103,661,084.21	92.78

### 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	101756038	17 河钢集 MTN015	50,000	5,247,500.00	4.70
2	101900223	19 川能投 MTN002	50,000	5,028,000.00	4.50
3	101900349	19 中交房产 MTN001	50,000	5,021,500.00	4.49
4	1922011	19 永赢租赁债	50,000	5,004,500.00	4.48
5	155196	19 津投 05	50,000	5,001,500.00	4.48

### 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国债期货交易情况说明

### 1.9.1 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。

### 1.9.2 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。

### 1.9.3 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。

## 1.10 投资组合报告附注

### 1.10.1

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。

### 1.10.2

本基金本报告期末未持有股票。

### 1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,641.76
2	应收证券清算款	5,523,023.69
3	应收股利	-

4	应收利息	1,038,046.14
5	应收申购款	1,123,023.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,691,735.40

#### 1.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	132007	16 凤凰 EB	1,973,000.00	1.77
2	113014	林洋转债	1,300,479.00	1.16
3	128010	顺昌转债	938,430.00	0.84
4	127005	长证转债	804,010.08	0.72
5	113008	电气转债	729,720.00	0.65
6	128029	太阳转债	714,130.20	0.64
7	128036	金农转债	576,350.00	0.52
8	113515	高能转债	567,300.00	0.51
9	113013	国君转债	473,640.00	0.42
10	110041	蒙电转债	332,700.00	0.30
11	113009	广汽转债	330,780.00	0.30
12	123010	博世转债	328,290.00	0.29
13	113505	杭电转债	323,610.00	0.29
14	113510	再升转债	310,950.00	0.28
15	113517	曙光转债	250,460.00	0.22
16	113015	隆基转债	244,960.00	0.22
17	128030	天康转债	244,440.00	0.22
18	128018	时达转债	243,274.68	0.22
19	128027	崇达转债	237,041.42	0.21
20	127006	敖东转债	215,980.00	0.19
21	113016	小康转债	213,660.00	0.19
22	113506	鼎信转债	135,990.00	0.12
23	110040	生益转债	120,690.00	0.11
24	128019	久立转 2	116,340.00	0.10
25	113011	光大转债	114,870.00	0.10
26	123009	星源转债	114,270.00	0.10
27	113019	玲珑转债	112,970.00	0.10
28	128020	水晶转债	111,950.00	0.10
29	113017	吉视转债	111,110.00	0.10

30	110043	无锡转债	109,800.00	0.10
31	128042	凯中转债	107,690.00	0.10

### 1.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 1.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## 第八部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、自基金合同生效以来（2018年6月4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：

平安双债添益债券 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
2018.6.4-2018.6.30	0.34%	0.04%	-1.14%	0.41%	1.48%	-0.37%
2018.7.1-2018.12.31	2.96%	0.04%	2.50%	0.24%	0.46%	-0.20%
2019.1.1-2019.3.31	5.18%	0.22%	9.20%	0.48%	-4.02%	-0.26%
自基金成立以来	8.66%	0.12%	10.66%	0.35%	-2.00%	-0.23%

中证可转换债券指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%

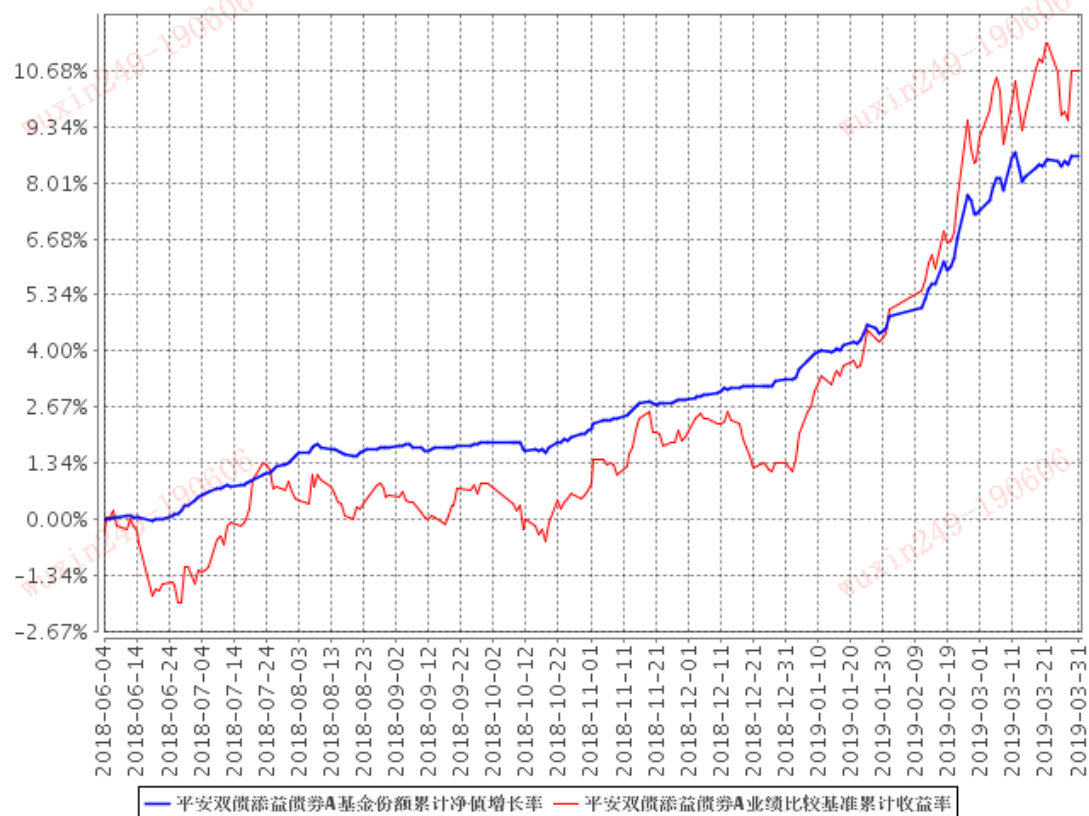
平安双债添益债券 C

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
2018.6.4-2018.6.30	0.32%	0.04%	-1.14%	0.41%	1.46%	-0.37%
2018.7.1-2018.12.31	2.74%	0.04%	2.50%	0.24%	0.24%	-0.20%
2019.1.1-2019.3.31	5.08%	0.22%	9.20%	0.48%	-4.12%	-0.26%
自基金成立以来	8.31%	0.12%	10.66%	0.35%	-2.35%	-0.23%

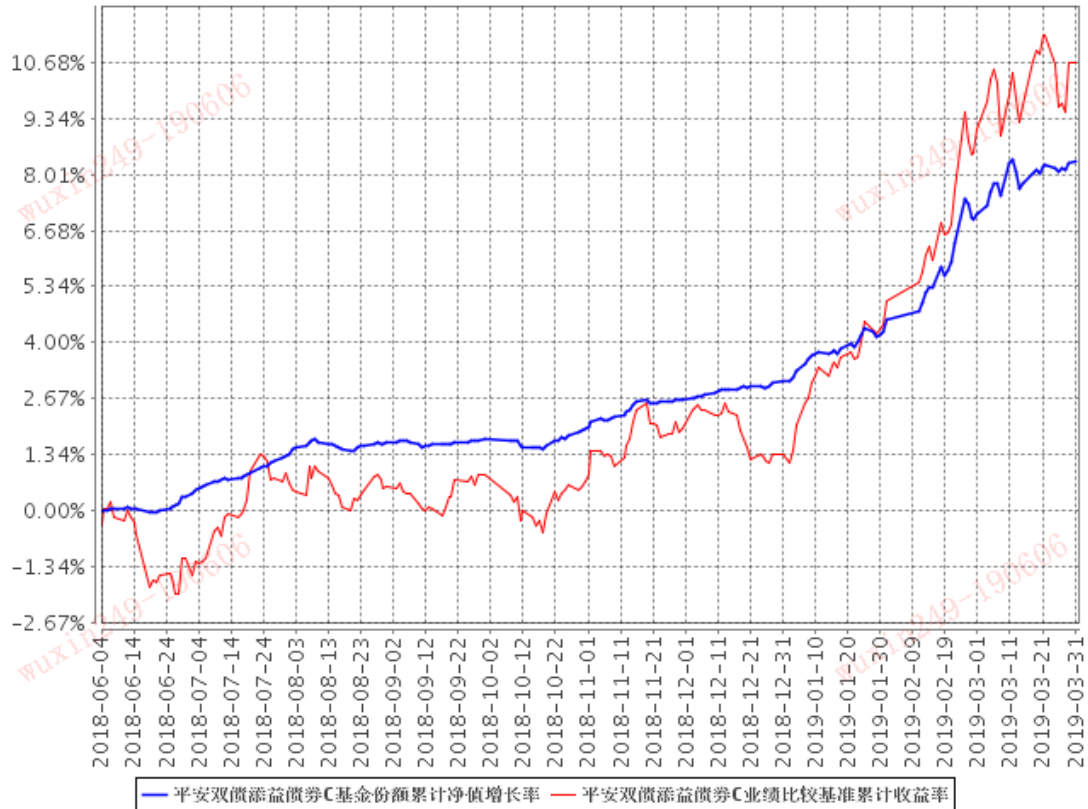
中证可转换债券指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%

## 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

平安双债添益债券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



### 平安双债添益债券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2018年6月4日正式生效，截至报告期末已满一年；  
 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## 第九部分 基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、本基金 C 类基金份额计提的销售服务费；
- 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、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、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 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 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

#### 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 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：



$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

### 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年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 的销售服务年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类份额销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

4、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自产品成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于产品成立一个月后的 5 个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

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。

## 第十部分 其他应披露事项

(一) 本基金管理人、基金托管人目前无重大诉讼事项。

(二) 最近半年本基金管理人、基金托管人及高级管理人员没有受到任何处罚。

(三) 2018年12月4日至2019年6月3日发布的公告：

1、2018年12月21日，平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海天天基金销售有限公司为销售机构的公告；

2、2018年12月24日，关于旗下部分基金新增北京肯特瑞基金销售有限公司为销售机构的公告；

3、2018年12月25日，关于旗下部分基金新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构的公告；

4、2018年12月29日，关于旗下部分基金参与工商银行定投申购费率优惠活动的公告；

5、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；

6、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；

7、2019年1月17日，平安双债添益债券型证券投资基金招募说明书更新（2018年第1期）以及摘要；

8、2019年1月19日，平安双债添益债券型证券投资基金2018年第4季度报告；

9、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；

10、2019年2月27日，平安基金管理有限公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告；

11、2019年3月12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；

12、2019年3月18日，关于旗下部分基金新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为销售机构的公告；

13、2019年3月27日，平安双债添益债券型证券投资基金2018年年度报告以及摘要；

14、2019年4月3日，关于旗下部分基金新增国盛证券有限责任公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告；

15、2019年4月3日，关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售的公告；

16、2019年4月19日，平安双债添益债券型证券投资基金2019年第1季度报告；

17、2019年5月10日，关于旗下部分基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告；

18、2019年5月14日，关于旗下部分基金新增上海陆亨基金销售有限公司为销售机构的公告；

（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。

## 第十一部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》等其他有关法律法规的要求及基金合同的规定，对 2019 年7月9日公布的《平安双债添益债券型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