平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2018年第2期

基金管理人:平安大华基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
二零一八年七月

重要提示

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2016年8月29日证监许可[2016]1978号文注册。本基金的基金合同于2017年1月25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。

本基金为股票型证券投资基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

本基金资产投资于港股,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动);汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失);港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市港股休市的期间下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。

本基金名称仅表明基金可以通过港股通机制投资港股,本基金为指数型基金,具有与标的指数相似的风险收益特征,基金资产对港股标的投资比例会根据指数调整变动而发生调整,存在不对港股进行投资的可能。

本基金可投资中小企业私募债券,当基金投资债券为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,可能造成基金资产损失。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。

本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。本基金是指数基金,其特定风险包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险,标的指数波动的风险,基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险,标的指数变更的风险;并且,指数的开市变更不代表未来表现。

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,并充分考虑投资者自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策,并对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人敬魔投资基金投资的“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,由投资者自行负担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照格尽职守,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。

本招募说明书(2018年第2期)所载内容截止日期为2018年7月24日,其中投资组合信息与基金业绩截止日期为2018年6月30日,有关财务数据未经审计。

本基金托管人平安银行股份有限公司于2018年8月2日对本招募说明书(2018年第2期)进行了复核。

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

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30000万元

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	18,210	60.7%
大华资产管理有限公司	7,500	25%
三亚盈鸿旅业有限公司	4,290	14.3%
合计	30,000	100%

基金管理人无任何重大行政处罚记录。

3.客服电话:400-800-4800(免长途话费)

二、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金融中心投资管理有限公司董事长兼任平安信托董事。

姚波先生,董事,硕士,1971年生,曾任RJMichalski 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)股份有限公司财务会计部总精算师,总经理助理等职务,现任中国平安保险(集团)股份有限公司资务副总经理兼首席财务官兼总精算师。

陈敏达先生,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;平安证券有限责任公司董事长;中国平安保险(集团)执行委员会执行委员,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长,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”了首席投资员,大华资产管理有限公司组合经理,国际股票部全球科技团队主管。

李兆良先生,独立董事,博士,1965年生。曾任新商局(0)工业区华南液化气船务公司远洋三课,二课,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聘律师,合伙人;现任广东华商律师事务所主任律师,合伙人。

李丽娟女士,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。曾任深圳市中华会计师事务所审计员,深圳市纺城集团会计部,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理门顾问负责人,秘书长助理;现任深圳市注册会计师协会副秘书长。

潘汉舞先生,独立董事,学士,1949年生。曾任新加坡赫伯特财务有限公司助理经理,新加坡化德银行副总裁,新加坡大华银行高级执行副总裁;现任彩旧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,通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

巢微文先生,监事长,硕士,1967年生。曾任江西省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)营业部副员,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,总行稽核室审计稽核室审计稽核主管,总行稽核监察部经理助理,广东海尊银行总行稽核监察部副总经理,总行稽核监察部总经理,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,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。

(六)资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

(七)中小企业私募债券投资策略

本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制,通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制,严格控制风险,对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估,并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响,通过信用研究和流动性管理后,决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

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90%以上的基金资产投资于股票;

(2)本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%;

(3)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,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;

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的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。

2.投资策略

本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理原则内进行适当的处理和调整,力争使跟踪误差控制在规定的范围之内。

本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(一)资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将主要投资于标的指数成份股和备选成份股。原则上本基金将采用指数复制法,按标的指数的成份股权重构建组合。特殊情况下,本基金将配合使用优化方法作为补充,以保证对标的指数的有效跟踪。

(二)股票投资策略

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资,根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合,并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。

1.股票投资组合的构建

本基金在建仓期内,将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法,以降低买入成本,特殊情况下,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,对基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。

2.股票投资组合的调整

(1)定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

(2)不定期调整

1)当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据指数公司发布的临时调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整;

2)根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;

3)特殊情况下,如基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益,决定配分持有现金或买入相关的替代性组合。

上述特殊情况包括但不限于以下情形:①法律法规的限制;②标的指数成份股长期停牌;③标的指数成份股流动性严重不足;④成份股上市公司存在重大违规行为,有可能面临重大的处罚或诉讼。

(三)债券投资策略

债券投资策略方面,本基金在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境分析方面,结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定不同类属资产的最优权重。

在微观市场定价分析方面,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等系列投资策略构建债券投资组合。

(四)权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究或策略定权证的合理估值,发现市场对股票权证的非理性定价;利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,来达到改善组合风险收益特征的目的。

(五)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,以获取阿尔法为主要目的,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判,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,通过多头或空头获期保值等策略进行获期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特性等,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。

(六)资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

(七)中小企业私募债券投资策略

本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制,通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制,严格控制风险,对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估,并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响,通过信用研究和流动性管理后,决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

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90%以上的基金资产投资于股票;

(2)本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%;

(3)本基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,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;

(4)本基金持有的全部股票市值和买入、卖出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200%;所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的价值,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规定;

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

(6)本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(7)本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议或其他基金管理人和基金托管人约定的协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资,基金管理人应制订严格的投资决策流程及风险控制制度,防范流动性风险,法律风险和操作风险等各种风险。

(8)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;

(9)本基金与私募类证券投资资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;

(10)本基金投资于中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

法律法规为(3)、(11)、(18)、(19)项以外,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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,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,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。

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)向基金管理人、基金托管人出资;

(5)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;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不受相关限制或按变更后的规定执行。

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,遵循基金管理人内部有关投资决策的规定,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。

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、授受委托或以其他任何形式为其他机构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)保护公司资产的安全、完整;

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法定授权的权力;

(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纲;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、业务操作制度、人事管理制度等;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、业务流程、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。它下的制订、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上层面的内容相违背,公司通过制度的持续检验,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,不断给订和增强公司制度的完备性、有效性。

4.关于投权、研究、投资、交易等方面的职责

(1)投权制度

公司的投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,确保公司各项决策制度的贯彻执行;各级经济投资分析管理程序必须遵循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规范范围内进行,公司重大业务的授权必须采取书面形式,授权程序必须留有书面记录。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,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权利制度,并应建立与投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绩效评估系统。

(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;应建立交易信息测系统,预警系统和交易系统,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,通过多头或空头获期保值等策略进行获期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特性等,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。

(5)基金会计核算

基金会计核算应建立健全会计核算业务流程,明确会计核算业务的内部控制,严格控制风险,并建立会计核算业务的应急预案,以防范信息技术系统故障造成的风险。

(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并规监察稽核工作,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,操作程序和违规惩戒。

法律合规监察部强化内部控制制度,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,迫究有关部门和人员的责任。

5.基金管理人关于内部控制制度声明书

(1)本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;

(2)本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

第二部分、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9日经收合并原平安银行股份有限公司,于2012年6月11日,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3250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1057.96亿元(还原营改增前的营业收入同比增幅1.67%),净利润231.61亿元(同比增长26.1%),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(含轻现)17,042.30亿元(较上年末增幅15.48%)。

平安银行已行设资产托管业务以来,以“稳健、创新发展处、信值核算处、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

陈志峰 男,中国籍,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,其有本外币资金清算,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行长;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月在招行武汉分行公司业务部总经理;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月在招行武汉分行碧口支行任行长;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管理,全面掌握银行产品包括托管业务产品的运营管理,其基础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3月15日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。

截至2018年6月末,平安银行股份有限公司托管净值规模合计604万亿,托管证券投资基金共113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、创业可转债债券型证券投资基金、嘉商保证金债券型证券投资基金、国投瑞银锐意改革三年定期开放债券型证券投资基金、中海增利债券型证券投资基金、中海信息产业灵活配置混合型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中海优质成长灵活配置混合型证券投资基金、中海分红增利灵活配置混合型证券投资基金、中海能源策略灵活配置混合型证券投资基金、中海消费主题灵活配置混合型证券投资基金、中海医疗保健灵活配置混合型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中海内需增强收益债券型证券投资基金、中海稳健收益债券型证券投资基金、中海可转换债券型证券投资基金、中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、中海盛利灵活配置混合型证券投资基金、中海盛丰灵活配置混合型证券投资基金、中海盛世