平安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）

2019年第1期

基金管理人：平安基金管理有限公司
基金托管人：平安银行股份有限公司
截止日期：2019年1月24日

重要提示

平安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系统管理风险，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（在内地开市香港休市的情形下，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，其有与标的指数相似的风险收益特征，基金资产过港股标的投资比例会根据指数调整等发生调整，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，指数的历史业绩不代表未来表现。

投资者风险收益特征：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。

本招募说明书（2019年第1期）所载内容截止日期为2019年1月24日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为2018年12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2019年2月11日对本招募说明书（2019年第1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：平安基金管理有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道福田路5033号平安金融中心34层
办公地址：深圳市福田区福田街道福田路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130000万元
存续期间：持续经营
联系人：吴小姐
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%
三亚盈鸿旅业有限公司	18,590	14.3%
合计	130,000	100%

基金管理人无任何受国太行政处罚记录。

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大厦汇通财富管理有限公司执行董事。

魏波先生，董事，硕士，1971年生，曾任KLM.Michalski Inc.（美国）养老金咨询分析员，Guardian Life Inc.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电商达吉港股有限公司执行董事；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。

杨亚洋女士，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。曾任新商局岭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）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，广东海信荣氏律师事务所专职法律师，合伙人；现任广东华南律师事务所任主任律师，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，深圳联业技术学院经济系教师、合计专业主任，深圳联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理事、秘书长助理；现任深圳市注册会计师协会副秘书长。

潘汉魏先生，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，新加坡化源制药副总裁，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

巢晓文先生，监事长，硕士，1967年生。曾任江西省军工“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；现任深圳市注册会计师协会理事、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兼任重庆市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。曾任职于埃马国控股和旗下的雷敦资产管理公司以及新加坡毕盛资产公司、鼎城资本管理公司，于2013年加入大华资产管理，现任区域总办公室主管。

郭喆女士，监事，硕士，1979年生。曾任广东福达集团财务总监助理，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。

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

（3）公司高管

罗春风先生，博士，高级经济师，1966年生。曾任中华全国总工会国际部干部，平安保险集团办公室主任助理，平安人寿广州分公司副总经理，平安人寿总公司人事行政部/培训部总经理，平安保险集团品牌宣传部总经理，平安人寿北京分公司总经理，平安基金管理有限公司副总经理，平安基金管理有限公司总经理。现任平安基金管理有限公司董事长兼任深圳平安大厦汇通财富管理有限公司执行董事。

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

付强先生，博士，高级经济师，1969年生。曾任中国华润总公司进出口副科长、申银万国证券研究所任高级研究员、申万巴黎基金管理公司高级研究经理、安信证券首席分析师、嘉实基金管理公司产品总监、平安证券有限责任公司副总经理。现任平安基金管理有限公司副总经理。

林婉文女士，1969年生，毕业于新加坡国立大学，拥有学士和荣誉学位，新加坡籍。曾任新加坡国际商会秘书处副主席，大华银行集团助理经理，电子渠道负责人、个人金融部现投资产品销售主管、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，毕业于耶菲尔德大学，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副总经理。现任平安基金管理有限公司副总经理。

陈玲江先生，曾任长，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

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，2015年加入平安基金管理有限公司，任职于品投资中心量化研究员，现任平安深证300指数增强型证券投资基金（2016-05-19至今）、平安鑫享混合型证券投资基金（2016-12-27至今）、平安鑫安混合型证券投资基金（2016-12-27至今）、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金（2017-01-25至今）、平安量化精选混合型证券投资基金（2017-06-17至今）、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金（2017-11-01至今）、平安量化精选混合型发起式证券投资基金（2018-02-01至今）、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（2018-09-21至今）基金经理。

钱晨先生，美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理，2017年10月加入平安基金管理有限公司，任职于平安证券投资部ETF指数投资经理，现任平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金（2018-03-26至今）、平安MSCI中国A股低波动交易型开放式指数证券投资基金（2018-06-20至今）、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（2018-11-06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：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，基金经理黄雅先生。

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，现任平安基金管理有限公司投资董事总经理，现担任平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金经理。

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日资交易部量化分析师，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，德意志银行投资策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，任职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指数量化增强型证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金经理。

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，现任研究中心研究执行总经理。

黄雅先生，北京大学硕士学位，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6月加入平安基金管理有限公司，现任平安鑫享又双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经理。

4.上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人职责

1.基金募集资金、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（不基金合同）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外有规定外，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.抵御社会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事项的有效执行承担责任；

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，并采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以下违反《基金法》的行为，并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）利用基金财产或露水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）泄漏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）超权或违规经营；

（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、盲用职权；

（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与投资外，直接或间接进行其它投资投资；

（9）协助、授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；

（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）从事证券投资的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

（8）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，则本基金投资不再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。

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）保护公司资产的安全；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法律法规限制的权力。

（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，它是公司制定内部控制制度的纲要和总提，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、操作规程等的具体说明；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善性、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了整个公司活动，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公司章程的规定，公司重大决策、重大事项、重大资金运作、重大人事任免、重大财务开支等事项必须按照公司章程的规定，公司授权管理活动，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干扰影响；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基金合同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、合理的信息方法和信息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，督察长可以以所公司相关会议，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、操作程序和班长环境。

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，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）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

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18日经中国银监会批准，中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行58%的股份，为平安银行的控股股东。截至2018年9月末，平安银行有 77 家分行，共1,056家营业机构。

2018年1-9月，平安银行实现营业收入866.64亿元（同比增长8.6%），净利润204.56亿元（同比增长6.8%），资产总额33,520.56亿元（较上年末增长12%），吸收存款余额21,346.41亿元（较上年末增长6.7%），发放贷款和垫款总额（含贴现）19,220.47亿元（较上年末增幅12.8%）。

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2月至1995年7月在招商银行武汉分行任客户经理；1995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2006年4月在招行武汉分行机构业务部任总经理；2006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月在招行武汉分行四业银行部任副总经理；自2008年2月加盟平安银行先后任公司业务部总经理、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部副总经理（主持工作）；2015年3月5日起任平安银行资产托管事业部总裁。

3.基金托管业务经营情况

2008年8月15日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。

截至2018年11月末，平安银行股份有限公司托管净值规模合计5.76万亿，托管证券投资基金共113只，其体包括华宿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、长信可转债券型证券投资基金、招商保证金快线货币市场基金、平安日增利货币市场基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、东吴中证可转债券指数分级证券投资基金、平安研究宝货币市场基金、红塔红土盛世普益灵活配置混合型证券投资基金、新华活期添利货币市场证券投资基金、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、新华塔窗回报债券型证券投资基金、鹏华安盈宝货币市场基金、平安新鑫先锋混合型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金、东吴稳定灵活配置混合型证券投资基金、平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、鹏华基金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、广发安享回报纯债债券型证券投资基金、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、广发安享回报纯债债券型证券投资基金、博时裕泰纯债债券型证券投资基金、鹏华基金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、嘉实稳盛债券型证券投资基金、长信先锋债券型证券投资基金、华润元大现金通货币市场基金、平安惠信定期开放债券型证券投资基金、平安惠泰灵活配置混合型证券投资基金、南方荣欣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、中海合惠增盈灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林瑞海新活力灵活配置混合型证券投资基金、南方顺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、博时丰庆一年定期开放债券型证券投资基金、安信消费定货币市场基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、平安惠享纯债债券型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、安信惠安定期开放债券型证券投资基金、鹏华弘腾成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、博时丰达纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、平安惠利纯债债券型证券投资基金、广发鑫盛18个月定期开放混合型证券投资基金、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金、鹏华丰盈债券型证券投资基金、平安惠享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、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、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、招商添宁3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、平安MSCI中国A股低波动交易型开放式指数证券投资基金（ETF）、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、招商添宁3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金。

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，保障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自己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；确保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数露人负责，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进行的化配置复核、确定不同类属资产的最优权重、投资决策支持、风险管理、业绩评估等方面，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，重点选择那些高流动性性较好、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。具体投资策略可收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等多模投资策略和建债券投资组合。

（四）模拟投资策略

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果确定权证的合理估值，发现市场对权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，通过多头或空头期货合约，来