（上接A55版）

联系人:张茹
电话:021-20613999
传真:021-68596916
客服电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com
(44) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址: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6F
法定代表人:陈柏青
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
(45) 上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:沈继伟
联系人:徐鹏
电话:86-021-50583533
传真:86-021-50583533
客服电话:400-067-6266
网址:http://admin.leadfund.com.
(46) 乾道金融信息服务(北京)有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117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
网址:www.qiandaojr.com
电话:400888080
(47) 南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址: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
客服电话:95177
网址:www.snjijin.com
(48) 北京格上富信基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:李悦章
联系人:曹庆展
联系电话: 010-85932450
网址:www.igesafe.com
客服电话:400-066-8586
(49) 北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层
法定代表人:李悦
联系人:张晔
电话:010-58845312
网址:www.chtfund.com
客服电话:400-8980-618
(50) 北京汇成基金销售有限公司
注册地址: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
电话:010-56282140
客服电话: 400-619-9059
网址:http://www.fundzone.cn
(51) 深圳深圳盈信基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1
办公地址:辽宁省大连市中山区南山路155号南山1910小区A3-1
法定代表人:苗宏升
网站: www.fundying.com
客服电话:4007-903-688
(52) 北京晟视天下基金销售有限公司注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座21&28层
法定代表人:蒋煜
联系人:殷雯
电话:010-58170844
传真:010-58170710
网址:www.shengshiview.com.cn
客服电话:400-818-8866
(53) 一路财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室
办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
联系人:刘栋栋
电话:010-88312877
传真:010-88312099
客服电话:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.com
(54) 北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
法定代表人:赵荣春
联系人:盛海娟
电话:010-57418813
传真:010-57569671
网址:www.qianjing.com
客服电话:400-893-6885
(55) 扬州国信嘉利基金销售有限公司
注册地址:广陵产业园创业路7号
办公地址:江苏省扬州市文昌西路56号公元国际320
法定代表人:王浩
网址:www.gxjlcn.com
客服电话:400-021-6088
(56) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
联系人:张晓辉
网址: www.taichengcaifu.com
客服电话:400-6411-999
(57) 北京微动利基金销售有限公司
注册地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼341室
办公地址:北京市石景山区古城西路113 号景山财富中心金融商业楼341室
法定代表人:梁洪军
联系人:季长军
电话:010-52609656
传真:010-51957430
网址:http://www.buyforyou.com.cn/
客服电话:400-819-6665
(58) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
联系人:蓝杰
电话: 021-65370077
传真: 021-55085991
客户服务电话: 021-65370077
网址: www.jiyufund.com.cn
(59) 北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
法定代表人:董浩
联系人:牛亚楠
联系电话:18610807009
客服电话:400-068-1176
网址:www.jimubox.com
(60) 深圳富济基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
联系人:刘昊
电话:0755-83999907
传真: 0755-83999926
客服电话:0755-83999907
网址:www.jinqianwo.cn
(61) 武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7栋23层1号、4号
办公地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7栋23层1号、4号
法定代表人:陶捷
联系人:孔繁
电话:027-87006009
网址: http://www.buyfunds.cn
客服电话:400-027-9899
(62) 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
(63) 大泰金石基金销售有限公司
注册地址:南京市建邺市江东中路359号
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
客服电话:021-22267995/400-928-2266
网址:www.dtfunds.com
(64) 奕丰金融基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸城大厦1115、1116及1307室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:项晶晶
电话:0755-8946 0500
传真:0755-2167 4453
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
(65) 深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址:深圳市南山区智慧广场第A栋11层1101-02
办公地址:深圳市南山区科苑路18号东方科技大厦18楼
法定代表人:陈姚坚
联系人:陈姿儒
网址:www.jfzinv.com
电话:4009500888
(66) 北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
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
客服电话:400-061-8518
网址:https://danjuanapp.com
(67) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A
法人代表:高锋
联系人:廖苑兰
联系电话:0755-83655588
网址:www.keynesasset.com
客服电话:400-804-8688
（68）深圳信诚基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋210室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市福田区时代财富大厦第49A单元
法定代表人:周文
联系人:杨涛
客服电话:0755-23946579
网址:www.ecpefund.com
（69）海银基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼
联系人:毛林
电话:021-80133597
传真:021-80133413
客服电话:400-808-1016
公司网址:www.fundhaiyin.com
(70) 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
（71）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
（72）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
（73）上海大智慧财富管理有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
办公地址:中国上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
法定代表人:申健
联系人:宋楠
客服电话:021-20292031
网址:https://www.wg.com.cn
（74）济安财富（北京）基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人:杨健
联系人:李海燕
客服电话:400-673-7010
网址:www.jianfortune.com
（75）万和证券股份有限公司
注册地址:海口市南沙路49号通信广场2楼
办公地址:深圳市深南大道7028号时代科技大厦20层西
法定代表人:朱治理
联系人:郭东彤
电话:0755-82830333-115
传真:0755-25170807
网址:www.wanhesec.com
（76）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.csco.com.cn
（77）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
（78）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
（79）北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
法定代表人:陈超
联系人:赵德赛
电话:4000888816
客服电话:95118
网址:http://fund.jd.com
（80）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/
（81）上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:何昳
电话:021-20691922
传真:021-20691861
客服电话:4008202899
网址:www.erichfund.com
（82）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
（83）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/
（84）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
（85）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/
（86）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
邮政编码:330000
法定代表人:徐丽峰
联系人:占文驰
电话:0791-86283372
传真:0791-86281305
（87）阳光人寿保险股份有限公司注册地址:海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层
法定代表人:李科
电话:010-85632771
传真:010-85632773
联系人:王超
客服热线:95510
公司网站:http://fund.sinosig.com
（88）苏州财路基金销售有限公司
注册地址:苏州工业园区华池街88号1幢1003室
办公地址:苏州市姑苏区苏站路1599号7号楼1101室
法定代表人:高志华
联系人:张君
电话:0512-68603767,18516765123
网站:www.cai6.com
客服电话:0512-68603767
二、注册登记机构
平安基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
办公地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
法定代表人:罗春风
电话:0755-22624581
传真:0755-23990088
联系人:张平
三、出具法律意见书的律师事务所
律师事务所:上海市通力律师事务所
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
电话:021-3135 8666
传真:021-3135 8600
经办律师:黎明、陈颖华
联系人:陈颖华
四、审计基金财产的会计师事务所
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
法定代表人:李丹
联系电话:（021）2323 8888
传真电话:（021）2323 8800
经办注册会计师:曹翠丽、陈怡
联系人:陈怡

第四部分基金的名称

平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

第五部分基金的类型

股票型证券投资基金

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

本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证沪港深高股息精选指数。在正常市场情况下,力争将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绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。

二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

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90%以上的基金资产投资于股票。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%,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。

三、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,在合理期限内进行适当的处理和调整,力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

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，决定部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、息差策略等积极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成果确定权证的合理估值,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，以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

（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,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,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

（4）本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

（5）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%;

（6）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%;

（7）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%;

（8）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%;

（9）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%;

（10） 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%;

（11）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;

（12）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;

（13） 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%;

（14）在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;在任何交易日日终,持有的买入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100%,其中,有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等;在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

（15）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%;

（16）基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

（17） 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书面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和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;

（18） 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;

（19） 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;

（20）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（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。

五、业绩比较基准

1、本基金的标的指数:中证沪港深高股息精选指数,及其未来可能发生的变更。

中证沪港深高股息精选指数从沪深A股以及符合港股通条件的港股中选取100只流动性好、连续分红、股息率高、盈利持续且具有成长性的股票作为指数样本股,采用股息率加权,以反映沪港深三地市场股息率高、盈利持续且具有成长性的股票的整体表现。

如果指数编制单位变更或停止中证沪港深高股息精选指数的编制、发布或授权,或中证沪港深高股息精选指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致中证沪港深高股息精选指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,变更本基金的标的指数。若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,报中国证监会备案并在指定媒介公告。若标的指数变更对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制机构变更、指数更名等）,则无需召开基金份额持有人大会,在报中国证监会备案后及时公告。

2、本基金业绩比较基准:

中证沪港深高股息精选指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%

本基金选择该业绩基准,是基于以下因素:

1.中证沪港深高股息精选指数由中证指数有限公司发布,反映了沪港深三地市场股息率高、盈利持续且具有成长性的股票的整体表现。

2.活期存款利率由中国人民银行公布,具有广大的知名度和市场影响力;

3.本基金的各投资标的的比例,选用该业绩比较基准能够真实反映本基金的风险收益特征。

若本基金标的指数发生变更,基金业绩比较基准随之变更。若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更而由此引起的业绩比较基准的变更,则基金管理人应就变更标的指数及业绩比较基准召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案并在指定媒介公告。若标的指数变更对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制机构变更、指数更名等）而由此引起的业绩比较基准的变更,则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

六、风险收益特征

本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。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。本基金还将投资港股通标的股票,需承担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。

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、有利于基金资产的安全与增值;

2、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;

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;

4、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理。

八、其他

1、基金的转型

若将来基金管理人推出以中证沪港深高股息精选指数为标的指数的交易型开放式指数基金（ETF）,本基金由基金管理人和基金托管人协商一致后可相应调整为该交易型开放式指数基金（ETF）的联接基金模式并对投资运作等相关内容进行调整,届时无需召开基金份额持有人大会,但需报中国证监会变更注册或备案并提前公告。

联接基金是指其绝大部分基金资产投资于同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF）,以紧密跟踪标的指数为目的的指数化产品。法律法规另有规定的从其规定。

九、投资组合报告

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2019年6月30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	13,376,676.33	92.47
	其中:股票	13,376,676.33	92.47
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	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	1,011,255.77	6.99
8	其他资产	77,630.90	0.54
9	合计	14,465,563.00	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	179,191.00	1.25
B	采矿业	181,959.00	1.27
C	制造业	6,819,953.94	47.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	172,505.00	1.20
E	建筑业	55,497.60	0.39
F	批发和零售业	77,660.00	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	1,007,920.00	7.02
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	151,516.00	1.06
J	金融业	173,821.00	1.21
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	63,172.00	0.44
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	8,883,196.54	61.88

1.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	1,797.10	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	538.20	0.00
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	2,335.30	0.02

1.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	493,731.17	3.44
B 消费者非必需品	1,159,367.25	8.08
C 消费者常用品	–	–
D 能源	496,497.70	3.46
E 金融	307,062.92	2.14
F 医疗保健	337,182.47	2.35
G 工业	409,077.09	2.85
H 信息技术	381,227.06	2.66
I 电信服务	245,178.84	1.71
J 公用事业	217,592.70	1.52
K 房地产	444,228.30	3.09
合计	4,491,145.49	31.29

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

1.3.1 报告期末指数投资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	01088	中国神华	34,500	496,497.70	3.46
2	000895	双汇发展	15,600	388,284.00	2.70
3	00868	信义玻璃	47,000	339,020.96	2.36
4	002601	龙蟒佰利	21,400	317,362.00	2.21
5	00806	惠理集团	67,000	307,062.92	2.14
6	00338	上海石油化工股份	110,000	299,964.06	2.09
7	01888	建滔积层板	46,500	292,874.00	2.04
8	00177	江苏宁沪高速公路	29,500	288,563.67	2.01
9	H02020	安踏体育	6,000	283,162.55	1.97
10	601006	大秦铁路	33,200	268,588.00	1.87

1.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002124	天邦股份	50	652.00	0.00
2	002001	新和成	30	578.70	0.00
3	603989	艾华集团	30	566.40	0.00
4	002033	丽江旅游	90	538.20	0.00

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末无权证投资。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1

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。

1.11.2

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,863.20
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	73,404.91
4	应收利息	182.05
5	应收申购款	2,180.74
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	77,630.90

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

1.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

第八部分基金的业绩

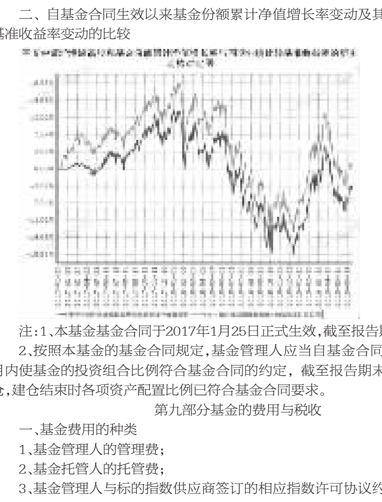
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、自基金合同生效以来（2017年1月25日）至2019年6月30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:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2017.1.25–2017.6.30	3.20%	0.33%	8.19%	0.56%	–4.99%	–0.23%
2017.7.1–2017.12.31	5.28%	0.70%	5.34%	0.68%	–0.06%	0.02%
2018.1.1–2018.6.30	–8.59%	1.15%	–7.86%	1.14%	–0.73%	0.01%
2018.7.1–2018.12.31	–15.64%	1.36%	–15.36%	1.37%	–0.28%	–0.01%
2019.1.1–2019.6.30	14.49%	1.25%	13.13%	1.24%	1.36%	0.01%
自基金合同生效至今	–4.07%	1.06%	0.55%	1.06%	–4.62%	–0.01%

业绩比较基准：中证沪港深高股息精选指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%

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



注:1、本基金基金合同于2017年1月25日正式生效,截至报告期末已满两年;

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,建仓结束时各项资产配置比例已符合基金合同要求。

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、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用许可费;

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1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×1.0%÷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。

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×0.20%÷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。

3、指数使用许可费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法从基金财产中支付指数使用许可费。指数使用许可费的计算方法如下:

H=E×0.02%÷当年天数

H为每日计提的指数使用许可费

E为前一日的资产净值

自基金成立的下一季度（自然季度）起,指数使用许可费收取下限为每季度（自然季度）5万元,即不足5万元时按照5万元收取。基金成立日所在季度,若按规模计提的指数使用许可费超过5万元,则按实际天数计提;若按规模计提的指数使用许可费不足5万元,则:

当季指数使用许可费=50,000元×基金当季存续天数÷当季天数。

指数使用许可费每日计算,逐日累计,按季度支付。基金管理人应于每个季度（自然季度）结束后10个工作日内与标的指数许可方结算该季度的指数使用费。

如果指数使用许可协议约定的指数使用许可费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

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。

（三）2019年1月25日至2019年7月24日发布的公告:

1、2019年1月29日，平安基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告;

2、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;

3、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;

4、2019年3月2日，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（2019年第1期）以及摘要;

5、2019年3月9日，关于暂停苏州财路基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告;

6、2019年3月15日，关于旗下部分基金新增上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告;

7、2019年3月15日，关于新增上海长量基金销售有限公司为销售机构并开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告;

8、2019年3月26日，关于旗下部分基金新增北京汇成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;

9、2019年3月26日，平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2018年年度报告以及摘要;

10、2019年3月29日，关于暂停北京钱景基金销售有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告;

11、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;

12、2019年4月18日，平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2019年第1季度报告;

13、2019年4月27日，关于平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金4月29日起暂停申购、赎回等业务的公告;

14、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;

15、2019年5月14日，关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构的公告;

16、2019年6月6日，关于旗下部分基金新增中信证券股份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;

17、2019年6月18日，平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告;

18、2019年6月30日，平安基金管理有限公司2019年6月30日基金净值披露公告;

19、2019年7月9日，关于子公司深圳平安大华汇通财富管理有限公司名称变更的公告;

20、2019年7月15日，平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2019年第2季度报告;

21、2019年7月19日，关于旗下部分基金新增阳光人寿保险股份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

1、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10月22日公布的《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》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27日