中國证券報

## (上接B087版)

电话:027-87617017 客服电话:95391/400-800-5000

网址:http://www.tfzg.com

首创证券有限责任公司 注册地址:北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座 办公地址:北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座

联系人:刑飞 电话:010-59366004

网址: www.sczq.com.cn 44) 奕丰金融服务(深圳)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

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 45) 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

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 (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7层05单元 办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层

法定代表人: 弭洪军 联系人:李娜

电话:021-33357030 传真:021-63353736 客服电话:400-876-5716

网址:www.cmiwm.com (47)南京证券股份有限公司

注册地址:南京市玄武区大钟亭8号 办公地址:南京市汀东中路389号

联系人:王万君 电话:025-58519523

客服电话:95386 网址:www.njzq.cr (48)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层两 法定代表人:朱治理

电话:0755-82830333-115

國計:www.wanhesec.com

场内销售机构:深圳证券交易所内具有基金销售业务资格、并经深圳证券 必为时间的15亿亿亿分之200万35月金金6日金分3亿亿万至水加量少交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位,具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的相关公告。

3、基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的 机构销售本基金或变更上述销售机构,并及时公告。

销售本基金或变更工处销售机构 二、基金登记机构 中国证券登记结算有限责任公司 住所:北京市西城区太平桥大街17号

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号 法定代表人:周明

联系电话:010-59378835 传真:010-59378839 联系人:朱立元

三、律师事务所和经办律师 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、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

平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF) 第五部分基金的类型

混合型证券投资基金

第六部分基金的运作方式 契约型开放式基金 第七部分基金的投资

在基金合同生效后18个月内,通过灵活运用固定收益投资和定向增发股票等投资策略,充分挖掘市场投资机会,在严格控制风险的前提下,力争基金资产的长期稳健增值。本基金转为上市开放式基金(LOF)后,通过合理配置大类资产和 精选投资标的,在严格控制下行风险和保持资产流动性的基础上,力争实现基 金资产的长期稳健增值。

二、投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行、上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债

券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券、中 、企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期 存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期 货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须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:股票资产占基金资产的比例为0-30%;封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当 保持不低于交易保证金一倍的现金:转为上市开放式基金(LOF)后,每个交易 10日終在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持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%。 权证 股指期货 国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行, 前述 现现及及各国金融工等13%及11亿3所积亿产品次级重量60%到3%定14门,则是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、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变更投资品种的投资比例限制, 基金管理人在

三、投资策略 -) 本基金在基金合同生效后18个月内(含),通过对宏观经济,行业分 析轮动效应与运向增发项目优势的深入研究的基础上,利用定向增发项目的事件性特征与折价优势,优选能够改善。提升企业基本面与经营状况的定向增发

履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

股票进行投资。将定向增发改善企业基本面与产业结构作为投资主线,形成以 1、大类资产配置策略 本基金通过对宏观经济环境,财政及货币政策,资金供需情况等因素的综

一条基金通过对公然运行小领、约100及门口及项、10页时间的证书包条口3项合分析以及对资本市场趋势的判断,结合主要大类资产的相对估值,合理确定基金在股票、债券、现金等各类资产类别上的投资比例,并在基金合同投资范围 约定的范围下适时进行动态调整。 2、定向增发股票投资策略 定向增发是指上市公司向符合条件的特定投资者(包括大股东、机构投资

者、自然人等)非公开发行股票的融资方式。本基金将对进行非公开发行的上市 看、自然(大等/ / 本公开及/ ) 政府的账员/ ) 3。"本盛业市外及( ) 中公开及/ ) 印立印 公司从估值/ 水平以及成长性两个角度出发进行基本面分析,结合市场未来走势 进行判断,从战略角度评估参与定向增发的预期中签情况、预期损益和风险水 平。充分考虑定向增发的一二级价差,并在严格掌控投资组合风险与收益的前 平。70万号85年10月8日的一点40万星,开任广告争龙汉京县百风座与收益的制度,表现大量的参与其定向增发项目。在定向增发股票领定期持束后,本基金将根据对股票内在投资价值和成长性的判断,结合股票市场环境的分析,选择适当的 时机卖出

17时美田。 本基金采用股票定量和定性分析方法,从估值水平和发展前景两个角度,通过财务和运营数据分析市场现有定向增发项目。本基金主要从行业景气度、 盈利能力, 成长能力以及估值水平等方面进行考量, 主要指标包括: 各行业公司 盤利能刀,成长能刀以及恰值水平等刀间处行今重,主要指标设括;各行业公司 的估值指标(如PE、PB、PB/CA,PS、限息率等),成长性指标(主营业务收入增长 率、净利润增长率、毛利率增长率等),现金流量指标和其他财务指标。从中选出 价值相对低估,成长性确定,现金流量状况好,盈利能力和偿债能力强的公司,

在定量分析的基础上,本基金通过分析备选定向增发项目所对应的公司的 业务环节的竞争优势和劣势,分析定向增发项目对公司未来的影响。主要考虑 口。 1)在技术能力方面,选择研发团队技术实力强、技术的发展与应用前景广

1)住技术能力刀間, 於片型及動物以及 關并且在技术上具有一定护城河的公司。 2)在市场前景方面,需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强

度以及上市公司利用科技创新能力取得竞争优势、进而开拓市场的能力。 3)在公司治理结构方面,将从上市公司的管理层评价、战略定位和管理制 度体系等方面进行评价,通过定量分析和定性分析,最终确定股票投资组合,并 适时进行投资组合调整。

按照定向增发的对象、资金用途,区分为以下几种主要模式:

(1)大股东主导的定向增发投资 大股东主导的定向增发项目包括集团公司整体上市、实际控制人资产注

人、发行对象包含大股东或者大股东关联方的公司间资产置换重组,以及融资

收购大股东资产的几种定向增发项目。 (2)项目融资类定向增发投资 项目融资类的定向增发项目为定向增发项目中最常见的类别,目前市场上

坐的定向增发项目为项目融资类 (3)非大股东方参与资产重组的定向增发投资

通过定向增发项目实现资产重组是企业与其他主体对企业资产的分布状

态进行重新组合、调整、配置或对企业资产上的权利进行重新配置的过程。重组

前后公司的估值往往会有明显的改变。 (4)融资收购非大股东方资产的定向增发投资

对于融资收购非大股东方资产的定向增发项目,长期来看,公司能够通过定向增发项目中收归的资产实现企业基本面指标的优化,通过上下游产业并 购、合并同业竞争对手或跨行业并购实现公司主营业务的拓展,减少公司运营

成本或大幅提升市场占有率来重组企业现有资源,提升经营业绩。重组前后公 从本弘人福捷川市場口有学术重型正型戏有贞原, 建川亞昌亚坝。重型前市公司的估值往往会有明显的改变。 本基金将深入研究不同类别的定向增发项目在不同期限内对公司基本面 的影响,对定向增发项目可能带来的影响进行模拟分析,挑选具有绝对或相对 估值吸引力的公司股票,再通过分析和评估股权变化,结合预期盈利水平和成

长潜力,择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资,尽可能获取定向 增发项目给投资者带来的超额收益。 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 构建债券投资组合。 4. 衍生品投资策略

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

2)本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。投资原则为有于基金资 产增值,控制下跌风险实现保和锁定收益。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人 将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股 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、力大额中胸棘回等;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。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立衍生品投资决策部门或小组,负 责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策 流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。

3)国债期货投资策略 3月国际明识投资保险。 本基金参与国债期货的投资应符合基金合同规定的投资策略和投资目标。 本基金以套期保值为目的,根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,投资于 国债期货合约,有效管理投资组合的系统性风险,积极改善组合的风险收益特

货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置,谨慎进行投资,以调整债券组 合的久期,降低投资组合的整体风险。具体而言,本基金的国债期货投资策略包 括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管

理策略、流动性管理策略等。 木基全在运用国债期货投资控制风险的基础上 将审慎地获取相应的超额 中基並往26月国限財政投資任約以20世紀時期,特別中國地方、特里國地方取得於10日組制收益,通过国债期货方债券的多头替代和稳健资产仓位的增加,以及国债期货与债券的多空比例调整,获取组合的稳定收益。

基金管理人针对国债期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程,确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作,并明确相关 岗位职责。此外,基金管理人建立国债期货交易决策部门或小组,并授权特定的

管理人员负责国债期货的投资审批事项。 若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理从其最新规定,以 符合上述法律法规和监管要求的变化。

.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的已例限制,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散口和信用风险敞口变化进行风险评估,并充分考虑

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 蓝蓝以双叶小正显体等现分,蓝蓝自建入时似始甲 既原则,则是广怡的汉 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。 6、资产支持证券投资策略

6、资产义行业好投资率的 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 间效产型特证券的总体投资系统保护进行方面及效,以降国流成功生从险。 (二)本基金转为上市开放式基金(LOF)局,在积极把握宏观经济周期、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上,深入挖掘可能对行业 或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件,将事件性因素作为投资的主

线,形成以事件驱动为核心的投资策略。 1、大类资产配置策略 为有效实施投资策略,本基金将在资产配置允许的范围内,采取相对灵活

本基金将从宏观环境、政策因素、资金供求因素、证券市场基本面等角度进 行综合分析, 判断各类资产的市场趋势和预期风险收益, 在严格控制风险的前提下, 合理确定本基金在股票、债券、现金等大类资产类别的投资比例, 并根据 宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。 2、股票投资策略

本基金采用股票定量和定性分析方法,从估值水平和发展前景两个角度分析,并注重事件性因素对行业影响的分析。定量分析方法主要通过财务和运营数据分析,主要指标包括:各行业公司的估值指标(如PE、PB、PE/G、PS、股息率 况好、盈利能力和偿债能力强的公司。

定性分析是指在特定的市场阶段,针对不同类型的事件,分析其内外部驱动因素,变化方向;并采用深度价值挖掘和多层面立体投资分析体系,多层面地 分析备选股票所对应公司业务环节的竞争优势和劣势,分析公司治理和公司管

理方面的优势和劣势,行业历史及行业变革力量。 通过定量分析和定性分析,最终确定股票投资组合,并适时进行投资组合

本基金将影响个股估值的事件驱动因素归纳为如下几个方面: (1)股权激励投资策略 股权激励是指上市公司以本公司股票为标的,对其董事、监事、高级管理人

员及其他员工进行的长期性激励。股权激励通过将公司员工与股东的利益一致 化,使得员工在经营和管理公司的过程中更加关心公司的长期价值。 本基金将通过筛选、分析和评估股权激励因素驱动的备选股,结合公司所 在行业/所处的发展周期,择优选取成长性较好,满足较严格业绩指标、安全边

(2)股份增持和股份回购投资策略 股份增持包括股东增持和高管增持,其中股东增持是指上市公司股东及其 致行动人增持股份行为;高管增持是指上市公司高管及其一致行动人增持股 份的行为;股份回购是指公司按一定的程序购回发行或流通在外的本公司股份

。。 本基金将通过筛选、分析和评估股份增持和股份回购的备选股,结合增持 方背景、公司股权结构、市场环境等因素,择优选取首次披露增持,或增持数量 大、比例高。或前期超跌、所在行业刚转暖等几类个股,再结合预期盈利水平和成长潜力,择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

(3)高分红和高转送投资策略

高分红是指公司分红比例较高的股票。高转送是实施较高比例的送股或转 的股票。高送转公司往往具有股本较少/每股资本公积、未分配利润、净资产 较高/股价绝对值较高的特征。 本基金将通过筛选、分析和评估高分红和高转送转的备选股. 结合预期盈

利水平和成长潜力,择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

(4)业绩预告和超预期投资策略 业绩预告是指上市公司根据交易所规定所作用的关于净利润为负值 净利 运动以及运动。 通增域幅度超过50%以上、或实现和5%定列1F0出5次1。中型时分级阻止中型 海增域幅度超过50%以上、或实现和5%全项的公告,业绩超预期主要涉 及两方面:公司实际经营事业绩和分析师/市场一致预期。通过比较两者之间的 差距,可能会发掘出具有Alpha 收益的股票。 本基金将通过筛选和分析业绩预增和超预期的备选股,自下而上进行评

长性较好的公司讲行投资 再融资是指上市公司通过配股、增发和发行可转换债券等方式在证券市场 上进行的直接融资。再融资对上市公司的发展起到了较大的推动作用,无论是助力产业转型、新兴资产并购或是集团整体上市、引人战投,还是国有资本向重要行业、关键领域、优势企业集中,亦或是完善激励机制,推进员工持股,再融资

估,结合预期盈利水平(或一致预期)和成长潜力,择优选取安全边际较高、成

尤其是并购增发将是最为重要的资本运作工具。 本基金将通过筛选、分析和评估再融资的备选股,从经济转型和安全边际两个维度选择,评估其行业所处阶段及其发展前景,结合预期盈利水平和成长 潜力,择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。 (6)其他原权主起所权同、成员已权对印发门及门及员。 (6)其他P钟公司的重大因素 其他事件包括但不限于公司发布对预期业绩及行业造成极大影响的重要

产品或重大会同公生,有影响上下游公司的重大事项发生,公司遭遇重大倍机, 管理层发生重大变更等。此类事件会对公司的运营造成深远的影响,继而影响 本基金将通过筛洗,分析和评估发生重大变动的股票,结合其预期盈利水

债券投资策略方面 木基全在综合研究的基础上实施和极主动的组合管 理,采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进气债券资产的投资。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

(被范之初所川坳)市银门间川坳吴满苡广门以风坠(以缸行吐),足州对汉京弘旨吴满 资产进行优化配置和调整。确定不同类属资产的最优权国。 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 5/62/5/3、以115/8及/11911的/5/1104/11913/11924/5/3、1115/3/3/11925 构建债券投资组合。

4、衍生品投资策略 1)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 应公司基本商价农业的政员[[7]建同基础汉负法目的规则和财产权。依据代址的 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

2)本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。投资原则为有于基金资 增值,控制下跌风险实现保和锁定收益。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情 的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济日报。 及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人 将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股

指期货交易的投资比例。 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 用金融行生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。 基金管理人在进行股捐期货投资前将建立衍生品投资决策部门或小组,负

责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策 流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行

本基金参与国债期货的投资应符合基金合同规定的投资策略和投资目标。 本基金以套期保值为目的。根据风险管理的原则。在风险可控的前提下、投资= 国债期货合约,有效管理投资组合的系统性风险,积极改善组合的风险收益特

本基金通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断,并充分考虑国债期 的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置,谨慎进行投资,以调整债券

的久期,降低投资组合的整体风险。具体而言,本基金的国债期货投资策略

包括 套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金 策略, 流动性管理策略等

本基金在运用国债期货投资控制风险的基础上,将审慎地获取相应的超额 益,通过国债期货对债券的多头替代和稳健资产仓位的增加,以及国债期 。 养的多空比例调整,获取组合的稳定收益 基金管理人针对国债期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程,

保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作,并明确相 关岗 位职责。此外,基金管理人建立国债期货交易决策部门或小组,并授权特定

理人员负责国债期货的投资审批事项 若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理从其最新规定,以 今上述法律法规和监管要求的变化。 5、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 一条基本特別及人工了证证。 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 6、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 

四. 投资限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)股票资产占基金资产的比例为0-30%; 封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的 交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;转为上市开放式基金 《以下证金后,还当底157766》,又必体证至《日772年,不79年11776人公金年(LOF)后,每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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 前述现金不包括结管条付金 存出保证金 应收由购款等 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

, (4) 本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,不得超过途上市公司可流通股票的16%;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%;

5)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 (6) 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%;

(7) 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 (8)本基金在任何交易日买人权证的总金额,不得超过上一交易日基金资

(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

(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 (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)本基金曾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BB以上(含BB)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

(14)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 (15) 本基全进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金全额不得超过 基金资产净值的40%;本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为

级报告发布之日起3个月内予以全部卖出:

1年,债券回购到期后不得展期; (16)封闭期内, 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的200%; 转为上市开放式基金(LOF)后,本基金的基金资产总值不得超过基金资产净

(17) 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过基金资产净值 的10%;在封闭期内,其剩余期限不得超过本基金的剩余封闭运作期; (18)若本基金参与股指期货和国债期货投资的,应遵循以下限制

1)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 直的10%;持有的这人同意,持有的实人成而到现日。2011年,不得超过基金数户 6的10%;持有的这人同意拥发会分价值,不得超过基金数产净值的15%; 2)在封闭期内每个交易日日终,持有的实人国债期货和股指期货合约价值 与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%;转成上市开放式基金 (ICP) 后,各个交易日日终,持有的买人国债期货和股捐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、买人返售金融资产 

股票总市值的20%;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 4)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

过上一个交易日基金资产单值的20%;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%; 6)基金所持有的股票市值和买人、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规定: 6)基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买人 卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比

(19)转成上市开放式基金(LOF)后,本基金主动投资于流动性受限资产 市值合计不得超过本基金资产净值的16%。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; (20)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 關保持一致; (21)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。 除第(2)、(13)、(19)、(20)项以外,因证券、期货市场波动、证券发行人 解析(2/1,13/11/19/20/7),[alit:74,i3]可加級的,证分2对门合并,基金规模变动等基金管理人之外的因素数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。 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

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

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。

(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

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 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 董亚巨理八还用建亚则广头英雄亚巨理八、基亚尤巨八及其党权政乐、头际控制人或者与其有其他重大利等关系的公司发行的证券或者系编用内承销的证券,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 本基金的业绩比较基准是:

沪深300指数收益率\*20%+中证综合债捐数收益率\*80%。 业绩比较基准选择理由:沪深300指数选样科学客观,流动性高,是目前市 场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中证综合债指数具广泛市场代表 现工教有影响刀的股票投資业额比较基准。中址综合该指数具)之市场代表 性、旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。基于本基金的特征,使 用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化。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,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的,本基金管理人与基金托管人协商一致,可以变更业绩比较基准,在履行适当程 字后报中国证监会备案,并在中国证监会指定媒介及时公告,无需召开基金份

额持有人大会。 六、风险收益特征 本基金是混合型证券投资基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货

不確立 定代 口望证 分 以 页 盛 並 , 顶 纳 八 应 和 顶 妍 八 远 同 了 市场 基 金 , 但 低 于 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、有利于基金资产的安全与增值;

、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 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、投资组合报告 基金管理人的董事会及董事保证本报告所裁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

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。

占基金总资产的比例 项目 金额(元) 其中:股票 基金投资 其中:债券 告金属投资 金融衍生品投 其中: 买断式回购的买人; 其他资产 2,132,136.9 135,623,586.3 100.00

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

其他

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

\* 本基金本报告期末未持有股票 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 占基金资产净值比 例(%) 债券品种 公允价值(元) 央行票据 44.44 45,597,000.0 其中:政策性 40,411,000.0 企业债券 19,797,000.0 19.29 10.011.000.0 可转债(可交换债 41,167,430.0 40.12 13.24

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 债券名称 数量(张) 公允价值(元)

130,153,530.0

						D3 ( 70 )		
	1	111990194	19宁波银行 CD008	110,000	10,674, 400.00	10.40		
	2	018006	国开1702	100,000	10,234, 000.00	9.97		
	3	108604	国开1805	100,000	10,113, 000.00	9.86		
	4	108902	农发1802	100,000	10,063, 000.00	9.81		
	5	018005	国开1701	100,000	10,001, 000.00	9.75		
	1.6 扌	设告期末按公	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					
3-0-16	177 3/64	DET COO						

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 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

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股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券

9、2019年1月19日,关于平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)基金经理变

本基金本报告期末未持有国债期货投资。 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 本基金本报告期末未持有股票。 1.11.3 其他资产构成

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。 1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

本基金本报告期末未持有股指期货投资

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

1.10.1 本期国债期货投资政策

债券代码

金额(元) 39,730.73 500,000.00

应收股利 ,542,406.2 其他应收款 寺摊费用

债券名称

F转股期的可转换债券明

公允价值(元)

1	113014	林洋转债	2,643,250.00	2.58
2	132007	16凤凰EB	1,973,000.00	1.92
3	127007	湖广转债	1,563,370.25	1.52
4	132011	17浙报EB	1,560,400.00	1.52
5	132013	17宝武EB	1,313,640.90	1.28
6	132010	17桐昆EB	1,231,500.00	1.20
7	128010	顺昌转债	1,041,761.57	1.02
8	113012	骆驼转债	887,670.50	0.87
9	128041	盛路转债	681,750.00	0.66
10	123014	凯发转债	662,673.62	0.65
11	113506	鼎信转债	660,911.40	0.64
12	113512	景旺转债	645,850.00	0.63
13	123015	蓝盾转债	625,250.00	0.61
14	110042	航电转债	615,250.00	0.60
15	128024	宁行转债	597,690.78	0.58
16	123004	铁汉转债	587,950.00	0.57
17	128036	金农转债	576,350.00	0.56
18	127005	长证转债	574,950.00	0.56
19	110038	济川转债	573,379.60	0.56
20	123002	国祯转债	572,527.60	0.56
21	113019	玲珑转债	564,850.00	0.55
22	128044	岭南转债	563,200.00	0.55
23	113515	高能转债	561,627.00	0.55
24	128029	太阳转债	548,730.70	0.53
25	123010	博世转债	547,150.00	0.53
26	113505	杭电转债	539,350.00	0.53
27	123003	蓝思转债	536,100.00	0.52
28	128040	华通转债	533,887.27	0.52
29	113508	新凤转债	533,150.00	0.52
30	132009	17中油EB	509,500.00	0.50

1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人原因,分项之和与合计可能有尾差。 海八部分基金的业绩 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

曙光转债

二力转债

小康转债

298,047.40

98,283.60

名股票中存在流通受限情况的

一、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

113517

113016

报告期末前

本基金本报告期末未持有股票。

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 - 自基金合同生效以来(2017年4月26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 值增长 率标准 差② 较基准 收益率 (2) - (4) 2017.4.26-20 -0. 91% 0.84% 0.04% 1.75% 0.14% -0.10% -0. 98% 018.1.1-20 0.24% 0.54% 0.23% 0.01% 0.16% 0.24% 0.29% 7.36% 0.53% 6.43% 0.30% 0.93% 0.23% 中国成立以来 9.35% 0.25% 11.41% 0.24% -2. 06%

业绩比较基准:沪深300指数收益率\*20%+中证综合债指数收益率\*80 、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

平安县在集合COP基本技能是并产值者长空与国际建筑比较基础或位于的历史走 0.00% 

注:1、本基金基金合同于2017年4月26日正式生效,截至报告期已满两年; 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 

第九部分基金费用与税收

基金费用的种类

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、诉讼费和仲裁费;

5、基金份额持有人大会费用(包括但不限于场地费、会计师费、律师费和公 6、基金的证券、期货交易费用; 7、基金的银行汇划费用;

8、基金的开户费用、账户维护费用: 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

、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1.20%年费率计提。管理费的计

三、不列入基金费用的项目

3、《基金合同》生效前的相关费用;

H为每日应计提的基金管理费 日/7時日於17年20日 尼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

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

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 2. 基金托管人的托管费

计算方法如下: H=E×0.25% ÷ 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,该日累计至每月月末,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~

三、ハッツル本金並共和日999日 下列费用不列人基金费用: 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;

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人基金费用的

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

上述"一、基金费用的种类"中第3-10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。

项目 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 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

。 (三)2018年10月26日至2019年4月25日发布的公告:

1、2018年10月26日,平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)2018年第3季 2、2018年11月2日,关于平安大华基金管理有限公司注册资本、股权及法定 3、2018年11月28日,关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公

4、2018年11月29日,关于子公司深圳平安汇通财富管理有限公司增加注册

(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

5、2018年12月8日,平安鼎弘混合型证券投资基金招募说明书更新(LOF) (2018年第2期)以及摘要; 6、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; 7、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 8、2019年1月19日,平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)2018年第4季度

11、2019年3月27日,平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)2018年年度报

10、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

11、2019年3月29日,关于旗下部分基金参加中投证券费率优惠活动的公 12、2019年4月19日,平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)2019年第1季

度报告; 

次更新的招募说明书为准。

规的要求及基金合同的规定,对 2019 年12月21日公布的《平安鼎弘混合型证

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

券投资基金(LOF)招募说明书更新》进行了更新,本次主要是对"基金管理 平安基金管理有限公司

## 平安基金管理有限公司 关于暂停泰诚财富基金销售 **伏连** )有限公司办理相关销售

业务的公告 为维护投资者利益,平安基金管理有限公司(以下简称"本公司")自202 年3月24日起哲停泰城财富基金销售(大连)有限公司(以下调研、公本司、)石公园( 第一)办理本公司旗下基金的相关销售业务。投资人通过泰城财富持有的本公

司基金份额。可通过本公司办理基金交易业务、具体办理程序请咨询本公司客

投资者可通过本公司咨询有关详情:

平安基金管理有限公司

客户服务电话:400-800-4800 网址:www.fund.pingan.com

人"中基金经理信息进行了更新。

本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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险,敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件,并选择适合自身风 险承受能力的投资品种进行投资。

平安基金管理有限公司

## 平安鼎弘混合型证券投资基金 LOF)基金经理变更公告

安鼎弘混合型证券投资基金 基金名称 平安鼎弘混合 (LOF)(场内简称 平安鼎弘) 基金主代码 基金管理人名科 公开募集证券投资基金信息披露 理办法》 公告依据 基金经理变更类型 曾聘、解聘基金经理 共同管理本基金的其他基金经理姓名 离任基金经理姓名 2新任基金经理的相关信息 新任其全经理姓夕 任职日期 证券投资管理从业年限 P先生,北京大学西方经济学硕士研究生 先后担任易方达基金管理有限公司固定 交易员、固定收益研究员兼基金经理助理 9年6月加人平安基金管理有限公司,任[ 过往从业经历

任职日离 6期 基金名称 明开放债券型发 3式证券投资基 其中:管理过公募基金的名称及期间 是否已取得基金从业资格

工作需要

离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名

备案。

是否已按规定在中国基金业协会办理 变更手续 是否已按规定在中国基金业协会办5 注销手续

平安合慧定期开放纯债债券型

发起式证券投资基金分红公告

1、公告基本信息 基金名称 基金简称 安合慧定开债 基金主代码 安基金管理有限公 基金托管人名称 通银行股份有限公司 基金合同生效日 开募集证券投资基金信息披露管 A法》及本基金合同和招募说明书 公告依据 收益分配基准日 截止 基准日基金份额净值(单位 0700 型基准日基金可供分配利益 (单位:人民币元) 26.489.306.86 截止基准日按照基金合同

有关年度分红次数的说明 注:基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准 的其条份额净值减土每单位其条份额收益分配条额后不够任于而值 木其条木

2、与分红相关的其他信息 权益登记日 现金红利发放日 权益登记日在注册登记机构平安基金管 理有限公司登记在册的本基金的全体基 分红对象 对于选择红利再投资方式的投资者,将以 2020年3月25日的基金份额净值为计算 基准确定再投资份额,本基金注册登记 构将于2020年3月26日对红利再投资的 红利重投资相关事项的说明 基金份额进行确认。2020年3月27日起 投资者可以查询、赎回红利再投资的 税收相关事项的说明

账户划出

享有本次分红权益,权益登记日申请赎回、转换转出的基金份额享有本次分红 。 (2)对于未选择具体分红方式的投资者,本基金默认的分红方式为现金分 红。本次分红确认的方式按照投资者在权益登记日之前最后一次选择的分红方

或通过销售机构提供的其他非现场交易方式修改分红方式 投资者在权益登记

权益登记日(2020年3月25日)注册登记机构可以受理分红方式变更申请 但该申请仅对以后的收益分配有效,而对本次收益分配无效。

基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。本公司提醒投资者,投资者投资于基金前应认真阅读本基金的 基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

是否已按规定在中国基金 业协会注册/登记

4 其他需要说明的事项 上述事项已在中国基金业协会完成相关手续,并报中国证监会深圳监管局

注:选择现金红利方式的投资者的红利款将于2020年3月26日自基金托 3、其他需要提示的事而 (1)权益登记日以后(含权益登记日)申请申购、转换转人的基金份额不

(3) 持有人可登录本公司的网站或拨打本公司客服电话查询注册登记系 (3) 19月7日以及水平公司19月7日以及11年公司合版电由且间压加量记录 统记录的分红方式、投资者如需投置或修改本次分红方式,请务必于权益登记 日之前一日的交易时间结束前(即2020年3月24日15:00前)到销售机构网点

(4)投资者还可以到本基金的代销机构查询本基金本次分红的有关情况 ①登陆本公司网站:www.fund.pingan.com

②投打本公司客户服务热线。400-800-4800 ③平安基金管理有限公司直销网点及本基金各代销机构的相关网点(详见

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证

费用相关事项的说明

本基金招募说明书及相关公告)

平安基金管理有限公司