平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

基金管理人：平安大华基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：上海证券交易所
上市时间：2018年1月26日
公告日期：2018年1月23日

一、重要声明与提示

《平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所基金业务办事指南》的规定编制，平安大华基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所（以下简称“上交所”）对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告书未涉及的有关内容，投资者欲了解本基金的详细情况，请投资者详细查阅刊登在中国证监会指定媒介和平安大华基金管理有限公司网站（www.fundpingan.com）上的《平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

1、基金名称：平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金
2、基金二级市场交易简称：平安300
3、二级市场交易代码：510390
4、基金申购、赎回简称：平安300
5、申购、赎回代码：510391
6、截至公告日前两个工作日即2018年1月19日基金份额总额：1,369,549,992.00份
7、截至公告日前两个工作日即2018年1月19日基金份额净值：4.2847元/份
8、本次上市交易份额：1,369,549,992.00份
9、上市交易场所：上海证券交易所
10、上市交易日期：2018年1月26日
11、基金管理人：平安大华基金管理有限公司
12、基金托管人：中国工商银行股份有限公司
13、上市推荐人：平安证券股份有限公司
14、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：平安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司（上述排名不分先后）。

（3）网上投资者申购赎回代办券商，本公司将另行公告。本公司可根据情况变更申购赎回代办券商，并及时公告。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会2017年11月8日证监许可【2017】2056号。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：2017年12月4日至2017年12月15日。其中，网下现金认购和网下股票认购的发售日期为2017年12月4日至2017年12月15日，网上现金认购的发售日期为2017年12月13日至2017年12月15日

5、发售面值：1.00元人民币。

6、发售期限：网下现金认购10个工作日，网上现金认购3个工作日。

7、发售方式：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。

8、发售机构：

（1）网下现金直销机构：平安大华基金管理有限公司直销柜台

（2）网下现金发售代理机构：平安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司（上述排名不分先后）。

（3）网上投资者申购赎回代办券商，本公司将另行公告。

（4）网上发售申购机构：平安大华基金管理有限公司直销柜台

（5）基金合同生效

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

2018年1月16日发布《份额折算的公告》

2018年1月23日发布《份额折算结果的公告》

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规，《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）有如惩可能对基金份额产生误导性影响或引起投资人或的任何公共传播媒介中出现的或者市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规，《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产；

（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人根据的计提和支付、基金托管人根据的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收入分配、基金份额资金所等行为的合法性、合规性进行监督和检查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》和有关法律法规规定的行为，将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将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函，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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

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

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为平安证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；

2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

（一）中国证监会准予本基金注册的文件

（二）《平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（三）《平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

（四）《平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件和营业执照

（七）基金托管人业务资格批件和营业执照

（八）关于本基金上市交易的重要公告

（九）上海证券交易所要求的其他文件

十四、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：平安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司（上述排名不分先后）。

上述排名不分先后。若有新增基本金的申购、赎回代办券商，本公司将另行公告。

8、本次上市交易份额：1,369,549,992.00份

9、上市交易场所的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2018年1月19日，本基金份额持有人户数为10101户，平均每户持有的基金份额为135,585.58份。

（二）持有人结构

截至2018年1月19日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为1,222,432,894.00份，占基金总份额89.33%；个人投资者持有的基金份额为146,117,098.00份，占基金总份额的10.67%。

（三）前十名基金份额持有人情况

截至2018年1月19日，前十名基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额（份）	占基金总份额的比例（%）
1	中国平安人寿保险股份有限公司－分红－个险分红	598,489,491.00	43.70%
2	中国平安人寿保险股份有限公司－万能－个险万能	323,184,215.00	23.60%
3	平安大华基金－平安银行－平安证券股份有限公司	119,704,115.00	8.74%
4	中国平安财产保险股份有限公司－传统－普通保险产品	47,878,939.00	3.50%
5	中国平安人寿保险股份有限公司－投连－个险投连	16,759,335.00	1.22%
6	中国平安人寿保险股份有限公司－投连－团险投连	15,561,358.00	1.14%
7	中国平安人寿保险股份有限公司－分红－团险分红	15,560,494.00	1.14%
8	郑志国	7,179,085.00	0.52%
9	金元顺安基金－南京银行－海通证券股份有限公司	4,786,057.00	0.35%
10	中国平安保险（集团）股份有限公司企业年金计划－招商银行股份有限公司	4,548,270.00	0.33%
合计		1,153,651,359.00	84.24%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：平安大华基金管理有限公司

2、法定代表人：罗春风

3、注册资本：人民币30000万元

4、住所及办公地址：深圳市福田区福田街道益田路6033号平安金融中心34层

5、设立批准文号：中国证监会证监许可【2010】1917号

6、工商登记注册的法人营业执照文号：统一社会信用代码91440300717884781XL

7、经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

8、股权结构：平安信托有限责任公司60.7%；大华资产管理有限公司25%；三亚渔湾旅业有限公司14.3%。

9、内部组织结构及职能：

投资研究部	负责权益类、固收类基金产品的投资运作及研究工作
衍生品投资中心	负责数量化产品的投资运作及研究工作
资产配置事业部	负责FOF及ETF指数产品的投资运作及研究工作
资本市场专户部	负责资本市场专户产品投资及研究工作
渠道销售中心	基金产品销售工作
产品研发中心	负责产品开发、设计、报批及产品管理工作
互联网金融业务中心	负责互联网渠道以及集团内综合开拓在公募基金及专户产品的代销和直销合作等
基金运营部	负责基金会计、TA及清算、交易等相关工作
系统规划中心	负责系统规划、开发相关工作
法律合规监察部	负责法律合规监察相关工作
资本市场风险监控室	负责公募及资本市场专户风险控制及投资绩效分析、投资监测工作
企划财务部	负责企划、财务等相关工作
综合部	负责人事行政、客户服务等综合工作

10、人员情况：

截止到2017年11月，我公司共有员工298人，博士8人、硕士161人、本科120人，其他9人

11、信息披露负责人：周明晴

咨询电话：400-800-4800

12、基金管理业务情况简介：

截至2017年11月底，平安大华基金管理有限公司旗下共管理43只开放式基金及多只专户产品，旗下管理的基金包括平安大华财富宝货币市场基金、平安大华日增利货币市场基金、平安大华安享类型货币市场基金、平安大华安享类型货币市场基金、平安大华保本混合型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资基金、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华安鑫保本混合型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华安鑫定期开放债券型证券投资基金、平安大华安享灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠享纯债债券型证券投资基金、平安大华惠睿纯债债券型证券投资基金、平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金、平安大华惠利纯债债券型证券投资基金、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金、平安大华惠元纯债债券型证券投资基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、平安大华惠欣纯债债券型证券投资基金、平安大华惠裕纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫享灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫先锋灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫众灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫睿灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫丰灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫享灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫荣灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫安灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫盈灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、平安大华行业先锋混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金、平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智慧制造灵活配置混合型证券投资基金、平安大华资源精选灵活配置混合型证券投资基金、平安大华安鑫定期开放混合型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资基金、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金、平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金、平安大华鼎庄定期开放灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎弘混合型证券投资基金、平安大华鼎泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、平安大华沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安大华沪港深股票型证券投资基金、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金

13、本基金基金经理简介

（1）基金经理人

1、基金经理人：李宁博士，南京大学和上海证券交易所博士后，曾任职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017年2月加入平安大华基金管理有限公司，现任资产配置事业部ETF指数部指数投资总监。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（简称“中国工商银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

首次注册登记日期：1984年1月1日

注册资本：人民币356,640,625.71万元

法定代表人：易会满

托管部门信息披露联系人：洪渊

传真：（010）66105798

中国工商银行客服电话：95588

2、基金托管部门及主要人员情况

截至2017年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工218人，平均年龄30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、证券投资基金托管情况

作为中国金融综合服务的先行者，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，展现出同行的市场形象和影响力，建立了国内托管银行外最丰富、最成熟的资产品线，拥有包括证券投资基金、信托产品、保险资产、社会保障基金、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专户产品、BSCROW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2017年6月，中国工商银行共托管证券投资基金743只，自2002年成为第一家托管开放式基金的商业银行以来，中国工商银行连续十一年获得香港《亚洲货币》、香港《财资》、英国《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49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。

（三）上市推荐人

平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：刘世安

联系人：石静武

联系电话：0755-22631117

传真：0755-82400862

（四）一级交易商

序号	代理机构名称	代理机构信息
1	华鑫证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元 办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元 法定代表人：俞洋 联系人：杨莉娟 电话：021-54967552 客服电话：4001099-918 网址：www.cfsc.com.cn
2	新时代证券股份有限公司	注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 法定代表人：叶顺德 联系人：田芳芳 联系电话：010-83561146 客户服务电话：95399 网址：www.xsdzq.cn
3	国信证券股份有限公司	注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 法定代表人：何如 联系人：周杨 电话：0755-82130833 客服电话：95536 网址：www.guosen.com.cn
4	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 联系电话：010-83574507 客服电话：4008-888-888或95551 网址：www.chinastock.com.cn
5	中泰证券股份有限公司	注册地址：济南市市中区经七路86号 办公地址：山东省济南市市中区经七路86号 法定代表人：李玮 联系人：许基华 电话：021-20315290 客服电话：95538 网址：www.zts.com.cn
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 客户服务电话：95587或4008-888-108 传真：010-65182261 网址：www.csc108.com
7	广发证券股份有限公司	注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室 办公地址：广州市天河北路183号大都会广场5、7、8、17、18、19、38-44楼 法定代表人：孙树明 联系人：黄茂 客户服务热线：95575 网址：http://www.gf.com.cn
8	招商证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层 法定代表人：霍达 联系人：黄晓莉 联系电话：0755-82960167 客服电话：95565、4008888111 网址：www.newone.com.cn

（五）验资机构

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号企业天地2号普华永道中心11楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号普华永道中心11楼

法定代表人：李丹

联系人：边晓红

联系电话：（021）2323 8888

传真电话：（021）2323 8800

经办注册会计师：曹翠丽、边晓红

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金2018年1月19日资产负债表如下（未经审计）：

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资产：		负债：	
银行存款	122,417,236.57	短期借款	
结算备付金	10,571,429.57	交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产	5,459,779,197.20	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	5,459,779,197.20	应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	1,502,143.15
理财投资		应付托管费	300,428.61
权证投资		应付受托费	
基金投资		应付销售服务费	
衍生金融资产		应付投资顾问费	
可供出售金融资产减值准备		应付交易费用	3,763,562.14
买入返售金融资产	280,000,000.00	应付税费	
应收证券清算款		应付利息	
应收利息	1,065,828.64	应付利润	
应收股利		应付其他运营费用	
应收申购款		其他负债	134,865.59
其他资产		负债合计	5,700,999.49
		所有者权益：	
		实收基金	5,723,055,617.00
		资本公积	
		未分配利润	145,077,075.49
		所有者权益合计	5,868,132,692.49
资产总计：	5,873,833,691.98	负债与持有人权益总计：	5,873,833,691.98

注：本基金发行在外的基金份额为1,369,549,992.00份，基金份额净值为4.2847元。

八、基金投资组合

截止到2018年1月19日，本基金的投资组合如下：

（一）基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,459,779,197.20	92.95
	其中：股票	5,459,779,197.20	92.95
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	280,000,000.00	4.77
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	132,988,666.14	2.26
7	其他各项资产	1,065,828.64	0.02
8	合计	5,873,833,691.98	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

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	13,491,606.00	0.23
B	采矿业	173,089,259.50	2.95
C	制造业	2,049,493,119.29	34.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	143,130,472.08	2.44
E	建筑业	216,904,721.62	3.70
F	批发和零售业	108,806,406.86	1.85
G	交通运输、仓储和邮政业	159,345,126.87	2.72
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业	206,683,806.69	3.51
J	金融业	1,945,000,030.24	33.15
K	房地产业	296,214,961.29	5.05
L	租赁和商务服务业	61,523,485.64	1.05
M	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	36,852,535.00	0.61
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育	20,347,558.74	0.35
Q	卫生和社会工作	25,721,862.16	0.44
R	文化、体育和娱乐业	5,174,245.22	0.09
S	综合	5,459,779,197.20	93.04
	合计		

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	601318	中国平安	4,842,322	375,715,763.98	6.40
2	600519	贵州茅台	224,602	168,491,928.36	2.87
3	600036	招商银行	4,610,335	149,651,474.10	2.55
4	000333	美的集团	2,030,239	118,099,002.63	2.01
5	000651	格力电器	2,151,716	110,705,788.20	1.89
6	601166	兴业银行	5,572,779	101,703,216.75	1.73
7	600016	民生银行	10,565,500	96,251,705.00	1.64
8	600887	伊利股份	2,716,282	91,294,238.02	1.56
9	000002	万科A	2,173,920	85,695,926.40	1.46
10	601328	交通银行	12,281,900	82,902,825.00	1.41

（四）按债券品种分类的债券投资组合

截至2018年1月19日，本基金未持有债券。

（五）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

截至2018年1月19日，本基金未持有债券。

（六）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

截至2018年1月19日，本基金未持有资产支持证券。

（七）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

截至2018年1月19日，本基金未持有贵金属。

（八）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

截至2018年1月19日，本基金未持有权证。

（九）本基金投资的股指期货交易情况说明

截至2018年1月19日，本基金未持有股指期货。

（十）本基金投资的国债期货交易情况说明

截至2018年1月19日，本基金未持有国债期货。

1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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、处罚的情形。

2、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	1,065,828.64
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	1,065,828.64

4、持有的处于转股期的可转换债券明细截至2018年1月19日，本基金未持有可转债。

5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于2018年1月19日，前十名股票中不存在流通受限情况。

九、基金事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

2018年1月16日发布《份额折算的公告》

2018年1月23日发布《份额折算结果的公告》

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规，《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）有如惩可能对基金份额产生误导性影响或引起投资人或的任何公共传播媒介中出现的或者市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规，《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产；

（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人根据的计提和支付、基金托管人根据的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收入分配、基金份额资金所等行为的合法性、合规性进行监督和检查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》和有关法律法规规定的行为，将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将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函，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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

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

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为平安证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；

2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

（一）中国证监会准予本基金注册的文件

（二）《平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（三）《平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

（四）《平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件和营业执照

（七）基金托管人业务资格批件和营业执照

（八）关于本基金上市交易的重要公告

（九）上海证券交易所要求的其他文件

十四、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：平安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司（上述排名不分先后）。

上述排名不分先后。若有新增基本金的申购、赎回代办券商，本公司将另行公告。

8、本次上市交易份额：1,369,549,992.00份

9、上市交易场所的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2018年1月19日，本基金份额持有人户数为10101户，平均每户持有的基金份额为135,585.58份。

（二）持有人结构

截至2018年1月19日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为1,222,432,894.00份，占基金总份额89.33%；个人投资者持有的基金份额为146,117,098.00份，占基金总份额的10.67%。

（三）前十名基金份额持有人情况

截至2018年1月19日，前十名基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额（份）	占基金总份额的比例（%）
1	中国平安人寿保险股份有限公司－分红－个险分红	598,489,491.00	43.70%
2	中国平安人寿保险股份有限公司－万能－个险万能	323,184,215.00	23.60%
3	平安大华基金－平安银行－平安证券股份有限公司	119,704,115.00	8.74%
4	中国平安财产保险股份有限公司－传统－普通保险产品	47,878,939.00	3.50%
5	中国平安人寿保险股份有限公司－投连－个险投连	16,759,335.00	1.22%
6	中国平安人寿保险股份有限公司－投连－团险投连	15,561,358.00	1.14%
7	中国平安人寿保险股份有限公司－分红－团险分红	15,560,494.00	1.14%
8	郑志国	7,179,085.00	0.52%
9	金元顺安基金－南京银行－海通证券股份有限公司	4,786,057.00	0.35%
10	中国平安保险（集团）股份有限公司企业年金计划－招商银行股份有限公司	4,548,270.00	0.33%
合计		1,153,651,359.00	84.24%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：平安大华基金管理有限公司

2、法定代表人：罗春风

3、注册资本：人民币30000万元

4、住所及办公地址：深圳市福田区福田街道益田路6033号平安金融中心34层

5、设立批准文号：中国证监会证监许可【2010】1917号

6、工商登记注册的法人营业执照文号：统一社会信用代码91440300717884781XL

7、经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

8、股权结构：平安信托有限责任公司60.7%；大华资产管理有限公司25%；三亚渔湾旅业有限公司14.3%。

9、内部组织结构及职能：

投资研究部	负责权益类、固收类基金产品的投资运作及研究工作
衍生品投资中心	负责数量化产品的投资运作及研究工作
资产配置事业部	负责FOF及ETF指数产品的投资运作及研究工作
资本市场专户部	负责资本市场专户产品投资及研究工作
渠道销售中心	基金产品销售工作
产品研发中心	负责产品开发、设计、报批及产品管理工作
互联网金融业务中心	负责互联网渠道以及集团内综合开拓在公募基金及专户产品的代销和直销合作等
基金运营部	负责基金会计、TA及清算、交易等相关工作
系统规划中心	负责系统规划、开发相关工作
法律合规监察部	负责法律合规监察相关工作
资本市场风险监控室	负责公募及资本市场专户风险控制及投资绩效分析、投资监测工作
企划财务部	负责企划、财务等相关工作
综合部	负责人事行政、客户服务等综合工作

10、人员情况：

截止到2017年11月，我公司共有员工298人，博士8人、硕士161人、本科120人，其他9人

11、信息披露负责人：周明晴

咨询电话：400-800-4800

12、基金管理业务情况简介：

截至2017年11月底，平安大华基金管理有限公司旗下共管理43只开放式基金及多只专户产品，旗下管理的基金包括平安大华财富宝货币市场基金、平安大华日增利货币市场基金、平安大华安享类型货币市场基金、平安大华安享类型货币市场基金、平安大华保本混合型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资基金、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华安鑫保本混合型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华安鑫定期开放债券型证券投资基金、平安大华安享灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠享纯债债券型证券投资基金、平安大华惠睿纯债债券型证券投资基金、平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金、平安大华惠利纯债债券型证券投资基金、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金、平安大华惠元纯债债券型证券投资基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、平安大华惠欣纯债债券型证券投资基金、平安大华惠裕纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫享灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫先锋灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫众灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫睿灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫丰灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫享灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫荣灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫安灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫盈灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、平安大华行业先锋混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金、平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智慧制造灵活配置混合型证