

# **平安短债债券型证券投资基金 招募说明书摘要更新**

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇二〇年八月

## 重要提示

平安大华短债债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]161号文注册，基金合同于2018年5月16日正式生效。自2018年10月25日起，平安大华短债债券型证券投资基金的管理人法定名称由“平安大华基金管理有限公司”变更为“平安基金管理有限公司”。为保护投资者利益，避免对投资者造成混淆和误导，基金名称由“平安大华短债债券型证券投资基金”变更为“平安短债债券型证券投资基金（以下简称‘本基金’）”。

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积极管理风险，本基金的特定风险等。

本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、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，由投资者自行负责。投资者投资于本基金在极端情况下可能损失全部本金。

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，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本次更新的招募说明书仅涉及增设I类基金份额修订的内容，其他所载内容截止日期为2020年5月15日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期2020年3月31日。有关财务数据未经审计。

## 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：深圳福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 楼

办公地址：深圳福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 楼

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 130,000 万元

存续期间：持续经营

联系人：马杰

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）	股权比例
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%
三亚盈湾旅业有限公司	18,590	14.30%
合计	130,000	100%

基金管理人无任何受重大行政处罚记录。

#### 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汇通投资管理有限公司执行董事。

姚波先生,董事,硕士,1971年生。曾任 R.J.Michalski 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 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/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,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,同时兼任瑞士德科集团顾问、崇侨托管(香港)有限公司董事、数码通电讯集团独立非执行董事、United Investments Private Ltd 董事、United Orient Capital G.P. Ltd 董事、大华银行托管(香港)有限公司董事、United Pte Equity Investments (Cayman) Ltd 董事、新加坡大华亚洲(香港)有限公司董事、大华投资管理(上海)有限公司董事。

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官,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。

薛世峰先生，独立董事，硕士，1963 年生。曾任江西省行政学院老师、深圳市龙岗区投资管理公司投资部部长、龙岗实业股份有限公司总经理、法定代表人、深圳市鑫德莱实业有限公司总经理助理兼房地产部部长、监事会主席、法律顾问，后加入广东万乘律师事务所任专职律师，现任广东宏泰律师事务所高级合伙人、专职律师。

李娟娟女士，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部门临时负责人、秘书长助理；现任深圳市注册会计师协会副秘书长。

潘汉腾先生，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、新加坡花旗银行副总裁、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非执行董事、一合环保控股有限公司独立董事、速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

巢傲文先生，监事会主席，硕士，1967 年生。曾任江西客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（主持工作）、总行人力资源部总经理、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室，兼任重庆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。曾任职于淡马锡控股和旗下的富敦资产管理公司以及新加坡毕盛资产公司、鼎崑资本管理公司。于 2013 年加入大华资产管理，现任区域总办公室主管。

郭晶女士，监事，硕士，1979 年生。曾任广东溢达集团研发总监助理、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经理。

李峥女士，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稽核高级经理。

### （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汇通投资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。曾任新加坡国防部职员，大华银行集团助理经理、电子渠道负责人、个人金融部投资产品销售主管、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。

陈特正先生，督察长，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

段玮婧女士，中山大学硕士。曾担任中国中投证券有限责任公司投资经理。2016年9月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资研究部固定收益组投资经理。2017年1月起担任平安金管家货币市场基金（2017-01-05至今）、平安短债债券型证券投资基金（2018-05-16至今）、平安乐享一年定期开放债券型证券投资基金（2019-09-04至今）、平安乐顺39个月定期开放债券型证券投资基金（2019-12-25至今）、平安合聚1年定期开放债券型发起式证券投资基金（2020-03-30至今）基金经理。

段玮婧女士曾管理的基金名称及管理时间：平安交易型货币市场基金（2017-01-05至2019-07-12）、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（2018-01-19至2019-08-07）、平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金（2018-03-26至2019-08-07）、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（2018-04-26至2019-08-07）、平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

(2018-06-20 至 2019-08-21)、平安合丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金(2018-07-16 至 2019-08-21)、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金(2018-09-26 至 2020-02-11)、平安中短债债券型证券投资基金(2019-01-23 至 2020-03-09)。

张文平先生,南京大学硕士。先后担任毕马威(中国)企业咨询有限公司南京分公司审计一部审计师、大成基金管理有限公司固定收益部基金经理。2018年3月加入平安基金管理有限公司,现任固定收益投资中心投资执行总经理。同时担任平安短债债券型证券投资基金(2018-08-10 至今)、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金(2018-10-17 至今)、平安鑫安混合型证券投资基金(2019-01-31 至今)、平安如意中短债债券型证券投资基金(2019-04-03 至今)、平安惠聚纯债债券型证券投资基金(2019-05-31 至今)、平安交易型货币市场基金(2019-06-14 至今)、平安季享裕三个月定期开放债券型证券投资基金(2019-09-04 至今)、平安5-10年期政策性金融债债券型证券投资基金(2019-11-21 至今)基金经理。

张文平先生曾管理的基金名称及管理时间:平安日增利货币市场基金(2018-08-10 至 2019-09-18)、平安惠金定期开放债券型证券投资基金(2018-08-10 至 2019-10-21)、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金(2018-09-20 至 2019-10-21)、平安惠悦纯债债券型证券投资基金(2018-09-20 至 2019-10-21)、平安惠裕债券型证券投资基金(2019-03-07 至 2019-08-28)、平安中短债债券型证券投资基金(2019-01-23 至 2020-02-20)、平安3-5年期政策性金融债债券型证券投资基金(2019-01-31 至 2020-02-25)、平安惠安纯债债券型证券投资基金(2019-02-13 至 2020-03-12)、平安惠轩纯债债券型证券投资基金(2018-10-29 至 2020-04-09)。

### 3、固定收益投资决策委员会成员

固定收益投资中心投资执行总经理张文平先生,固定收益投资中心投资副总监周恩源先生,固定收益投资中心基金经理高勇标先生,固定收益投资中心基金经理田元强先生,固定收益投资中心基金经理 WANG AO 先生。

### 4、上述人员之间不存在近亲属关系。

## (三) 基金管理人职责

1、依法募集资金,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净值信息,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、编制季度报告、中期报告和年度报告;
- 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另有规定外,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,并且保证投资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、组织并参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基金事务的行为承担责任；

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、基金管理人在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、承担尽职调查等反洗钱工作职责，包括但不限于建立合理有效的反洗钱控制措施，对其自身客户开展反洗钱尽职调查等管控工作，确保所管理的资金来源合法，资金管理使用不涉及恐怖融资或其他违法犯罪活动，不涉及被联合国、美国、欧盟、英国、中国公安部等制裁规则制裁的人员或行为等。基金管理人应建立健全客户尽职调查等反洗钱内部控制机制，与基金托管人共享本业务项下客户尽职调查及其他相关情况；

28、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，并承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）利用基金财产或职务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）泄露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）越权或违规经营；
- （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、滥用职权；
- （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投资外，直接或间接进行其它股票投资；
- （9）协助、接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；

(8) 法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，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、接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) 保护公司最重要的资本：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违反规章的权力；

(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揽；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规章，是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、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备性、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授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。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，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业务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、合理的估值方法和估值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、操作程序和组织纪律。

法律合规监察部强化内部检查制度，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）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- （2）基金管理人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）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至2020年3月31日，中国银行已托管780只证券投资基金，其中境内基金735只，QDII基金45只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成

部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 第三部分 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

平安基金管理有限公司

办公地址：深圳福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 楼

法定代表人：罗春风

直销电话：0755-22627627

直销传真：0755-23990088

联系人：郑权

网址：[www.fund.pingan.com](http://www.fund.pingan.com)

#### 2、代销机构

##### 1) 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/>

##### 2) 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/>

##### 3) 和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼

办公地址：北京市朝阳区酒仙桥路 6 号院 2 号楼

法定代表人：温丽燕

联系人：董亚芳

联系电话：4000-555-671

客服电话：4000-555-671

网址：<http://www.hgccpb.com/>

#### 4) 大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

联系人：王清臣

传真：0411-39027835

客服电话：4000-899-100

网址：<http://www.fundzone.cn>

#### 5) 喜鹊财富基金销售有限公司

注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

法定代表人：王舰正

联系人：曹砚财、张萌

联系电话：010-58349088

客服电话：4006997719

网址：[www.xiquefund.com](http://www.xiquefund.com)

#### 6) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 2 号楼 9 层 1008

办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 2 号楼 9 层 1008

法定代表人：戎兵

联系人：魏晨

联系电话：010-52413385

客服电话：400-6099-200

网址: <http://www.yixinfund.com/>

7) 深圳市金海九州基金销售有限公司

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: 深圳市南山区海德三道 168 号航天科技广场 A 座 32 楼

法定代表人: 彭维熙

联系人: 彭维熙

联系电话: 0755-81994266

客服电话: 4000993333

网址: [www.jhjzfund.com](http://www.jhjzfund.com)

8) 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>

9) 北京度小满基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

办公地址: 北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦

法定代表人: 葛新

联系人: 孙博超

联系电话: 010-61952703

客服电话: 95055-4

网址: [www.baiyingfund.com](http://www.baiyingfund.com)

10) 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

联系人：王超

联系电话：010-85632771

客服电话：95510

网址：<http://fund.sinosig.com>

11) 东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦 16 楼

法定代表人：徐伟琴

联系人：付佳

联系电话：021-23586603

客服电话：95357-8

网址：<http://www.18.cn/>

12) 腾安基金销售（深圳）有限公司

办公地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦

法定代表人：刘明军

联系电话：0755-86013388-77386

客服电话：95017(拨通后转 1 转 8)

网址：<https://www.txfund.com/>

13) 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](http://www.jnlc.com)

14) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

电话：010-83363099

传真：010-83363010

客服电话：400-166-1188

网址：<http://8.jrj.com.cn>

15) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人：其实

联系人：高莉莉

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服电话：400-1818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

16) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 401 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号 903 室

法定代表人：杨文斌

联系人：徐超逸

联系电话：021-36696312

客服电话：400-700-9665

网址：<http://www.ehowbuy.com/>

17) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 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：祖国明

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

18) 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：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：党敏

联系电话：021-20691935

客服电话：400-820-2899

网址：http://www.erichfund.com/

19) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：浙江省杭州市余杭区同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人：吴强

联系人：董一锋

联系电话：0571-88911818

客服电话：952555

网址：http://www.5ifund.com/

20) 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 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1 号

法定代表人：王锋

联系人：王锋

联系电话：025-66996699

客服电话：95177

网址：http://www.snjijin.com/



## 21) 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

客服电话：400-8980-618

网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

## 22) 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

联系电话：010-56282140

客服电话：400-619-905

网址：<http://www.fundzone.cn>

## 23) 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

客服电话：400-818-8866

网址：[www.shengshiview.com.cn](http://www.shengshiview.com.cn)

## 24) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司

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

25) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融中心 38 层

法定代表人：张冠宇

联系人：王国壮

联系电话：010-85870662

传真：010-59200800

客服电话：400—819—9858

网址：www.datangwealth.com

26) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：黄伟

联系人：徐亚丹

联系电话：021-51327185

客服电话：400-799-1888

网址：www.520fund.com.cn

27) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区金钟路 658 弄 2 号楼 B 座 6 楼

法定代表人：燕斌

联系人：汤蕾

联系电话：021-51507071

客服电话：4000-466-788

网址: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

28) 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.jiuyufund.com.cn](http://www.jiuyufund.com.cn)

29) 上海中正达广基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址: 上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人: 黄欣

联系人: 戴珉微

电话: 021-33768132

客服电话: 400-6767-523

网址: [www.zzwealth.cn](http://www.zzwealth.cn)

30) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

办公地址: 北京市朝阳区工体北路甲 2 号盈科中心东门 2 层 216 室

法定代表人: 何静

联系人: 王重阳

联系电话: 400-618-0707

客服电话: 400-618-0707

网址: <http://www.hongdianfund.com/>

31) 上海攀赢基金销售有限公司

注册地址: 上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 488 号太平金融大厦 603 室

法定代表人：田为奇

联系人：吴卫东

客服电话：021-68889082

网址：www.pytz.com

32) 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

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

客服电话：400-821-9031

网址：www.lufund.com

33) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-349

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

联系电话：020-89629099

客服电话：020-89629066

网址：http://www.yingmi.cn/

34) 奕丰基金销售有限公司

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道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

电话：0755-8946 0507

传真：0755-2167 4453

客服电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

35) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市通州区亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 15 层

法定代表人：王苏宁

联系人：娄云

电话：4000888816

客服电话：95118

网址：http://fund.jd.com

36) 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

电话：4009500888

网址：www.jfzinv.com

37) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址：北京市朝阳区融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：赵旻

联系电话：010-61840600

客服电话：400-159-9288

网址：http://www.danjuanapp.com/

38) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

办公地址：北京市西城区金融街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：李一梅

客服电话： 400-817-5666

网址： [www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

39) 江苏银行股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中华路 26 号

办公地址：江苏省南京市中华路 26 号

法定代表人： 夏平

联系人：周研

客服：95319

网址： [www.jsbchina.com](http://www.jsbchina.com)

40) 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>

41) 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](http://www.jianfortune.com)

42) 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：冯周让

联系人：李宛真

电话：0755-82830333-196

传真：0755-25170807

网址：www.wanhesec.com

43) 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

44) 中国平安人寿保险股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 14、15、16、41、44、45、46 层

办公地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 14、15、16、41、44、45、46 层

法定代表人：丁新民

联系人：葛童

联系电话：021-38646046

客服电话：95511 转 1

传真：021-50475630

网址：http://life.pingan.com

45) 东亚银行（中国）有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 66 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 66 号

法定代表人：李国宝

联系人：张薇

客服电话：（8621）38663866

网址：www.hkbea.com.cn

(46)中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

联系人：刘昭宇

联系电话：010-63639681

客服电话：95595

网址：www.cebbank.com

(47)浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7 楼

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7 楼

法定代表人：吴承根

联系人：陈姗

联系电话：021-80108643

客服电话：967777

传真：0571-87902090

网址：www.stocke.com.cn

(48)平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

法定代表人：何之江

客服电话：95511-8

传真：0755-82400862

网址：www.stock.pingan.com

(49) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层



办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

(50)恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

电话：0471-3953168

传真：0471-3979545

客服电话：956088

网址：www.cnht.com.cn

(51)中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 20518 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号证券大厦

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

联系电话：021-20315117

客服电话：95538

传真：0531-68889752

网址：www.zts.com.cn

(52)第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15-20 楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

电话：0755-23838750

传真：0755-25838701

客服电话：95358

网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

(53)中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：毕明建（代）

联系人：刘书剑

电话：0755-83196207

传真：0755-83196250

客服电话：0755-83196207

网址：[www.cicc.com](http://www.cicc.com)

(54)中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：刘毅

客服电话：95532、400-600-8008

传真：0755-82026539

网址：<http://www.ciccwm.com>

(55)国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

电话：028-86690057、028-86690058

客服电话：95310

公司网址：www.gjzq.com.cn

(56)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 2 号绿地紫峰大厦 2005

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

(57)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

(58)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

法定代表人：贲惠琴

联系人：杨一新

联系电话：021-50206003

传真：021-50206001

客服电话：021-50206003

公司网站 <http://www.msftec.com>

(59)世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇  
对冲基金中心 406

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：李强

联系人：徐玲娟

电话：0755-83199553

客服电话：4008323000

网址：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

(60)中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

联系人：陈靖

联系电话：020-88836999

客户服务电话：95396

传真：020-88836984

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(61)浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：聂婉君

电话：010-59497361

传真：010-64788016

联系人：李艳

客户服务热线：4000125899

网址：[www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

(62)招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

成立时间：1987 年 4 月 8 日

联系人：邓炯鹏

联系电话：0755-83077278

客服电话：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(63)深圳前海微众银行股份有限公司

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：广东省深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座

法定代表人：顾敏

联系人：微众银行

联系电话：95384

客服电话：95384

网址：<https://www.webank.com>

(64)北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦

法定代表人：张东宁

联系人：周黎

客服电话：95526

网址：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(65)平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区益田路 5023 号

办公地址：广东省深圳市福田区益田路 5023 号

法定代表人：谢永林

联系人：赵杨

联系电话：0755-22166574

客服电话：95511-3

传真：021-50979507

网址：<http://bank.pingan.com>

(66)上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国上海自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：中国上海自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

法定代表人：冯轶明

联系人：范泽杰

联系电话：021-20538888

客服电话：021-20538888

网址：[www.zhengtongfunds.com](http://www.zhengtongfunds.com)

(67)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 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

联系电话：010-6083 3754

传真：010-5776 2999

客服电话：400-990-8826

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

(68)国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

联系电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：钟伟镇

网址：www.gtja.com

服务热线：95521 / 4008888666

(69)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：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：刘畅

联系电话：010-65608231

客服电话：400-8888-108

传真：010-65182261

网址：www.csc108.com

(70)广发证券股份有限公司

注册地址：广州市黄埔区中新广场知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客服电话：95575

传真：020-87557689

网址：www.gf.com.cn

(71)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

## (72)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

客服电话：400-8888-888/95551

传真：010-83574807

网址：www.chinastock.com.cn

## (73)安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

电话：0755-82555551

客服电话：400-800-1001

网址：www.essence.com.cn

## (74)渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：王星

电话：022-28451922

客服电话：4006515988

网址：www.ewww.com.cn

## (75)华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸



联系电话：0755-82492193

客服电话：95597

传真：0755-82492962（深圳）

网址：www.htsc.com.cn

(76)中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：姜晓林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：95548

传真：0532-85022605

网址：sd.citics.com

(77)信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081493

客服电话：95321

网址：www.cindasc.com

(78)长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：丁益

联系人：金夏

联系电话：0755-83516289

客服电话：400-6666-888

传真：0755-83515567

网址: [www.cgws.com](http://www.cgws.com)

(79)光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

联系人: 何耀、李芳芳

联系电话: 021-22169999

客服电话: 95525

传真: 021-22169134

网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(80)东北证券股份有限公司

注册地址: 吉林省长春市自由大路 1138 号

办公地址: 吉林省长春市自由大路 1138 号

法定代表人: 李福春

联系人: 安岩岩

电话: 0431-85096517

客服电话: 95360

传真: 0431-85096795

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(81)大同证券股份有限公司

注册地址: 大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址: 山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层

法定代表人: 董祥

联系人: 薛津

电话: 0351-4130322

传真: 0351-7219891

网址: [www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

(82)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：合肥市蜀山区南二环路 959 号财智中心华安证券 B1 座 0327 室

邮政编码：230081

法定代表人：李工

联系人：范超

联系电话：0551-65161821

客服电话：95318

网址：www.hazq.com

(83)天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

联系人：岑妹妹

电话：027-87617017

客服电话：95391/400-800-5000

网址：http://www.tfzq.com

(84)开源证券股份有限公司

注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

联系人：袁伟涛

电话：029-63387289

传真：029-81887060

客服电话：400-860-8866

网址：www.kysec.cn

(85)中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

联系人：杨威

电话：010-66107900

客户服务电话：95588

网址： [www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(86)中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

联系人：吴颖媛

联系电话：010-66596317

客服电话：95566

网址： [www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(87)交通银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

联系人：王菁

联系电话：021-58781234

客户服务电话：95559

网址： [www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(88)中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

联系人：王晓琳

联系电话：010-89937325

客服电话：95558

网址： [www.citicbank.com](http://www.citicbank.com)

(89)兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号兴业银行大厦

法定代表人：陶以平（代为履行法定代表人职权）

联系人：李玮琳

联系电话：021-52629999-211054

客服热线：95561

网址：www.cib.com.cn

(90)国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市新建区子实路 1589 号

办公地址：江西省南昌市新建区子实路 1589 号

法定代表人：徐丽峰

客服电话：956080

网址：www.gszq.com

## 二、基金登记机构

平安基金管理有限公司

注册地址：深圳福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 楼

办公地址：深圳福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 楼

法定代表人：罗春风

电话：0755-22624581

传真：0755-23990088

联系人：张平

## 三、律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系人：陈颖华

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、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：郭素宏、邓昭君

联系人：邓昭君

## 第四部分 基金的名称

平安短债债券型证券投资基金

## 第五部分 基金的类型

债券型证券投资基金

## 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

本基金主要通过重点投资短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。

### （二）投资范围

本基金投资于具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款）、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于短期债券的比例不低于非现金资产的80%。持有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%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金所指的短期债券是指剩余期限不超过397天（含）的债券资产，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分。

如果法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种或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，可以将其纳入投资范围或可以调整上述投资品种的投资比例。

### （三）投资策略

#### 1、组合久期配置策略

为保持本基金明显的收益风险特征，本基金将通过对宏观经济变量（包括GDP增长率、CPI走势、远期利率水平、市场短期资金流向、央行公开市场操作力度、货币供应量变动等）、债券市场整体收益率曲线变化、申购赎回现金流情况等因素的



综合分析和判断。同时，本基金通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置；当收益率曲线走势难以判断时，参考基准指数的样本券久期构建组合久期，确保组合收益超过基准收益。

在目标久期的执行过程中，将特别注意对信用风险、流动性风险及类属资产配置的管理，以使得组合的各种风险在控制范围之内。

## 2、类属资产配置策略

根据不同债券资产类品种收益与风险的估计和判断，通过分析各类属资产的相对收益和风险因素，确定不同债券种类的配置比例。主要决策依据包括未来的宏观经济和利率环境研究和预测，利差变动情况、市场容量、信用等级情况和流动性情况等。通过情景分析的方法，判断各个债券类属的预期持有期回报，在不同债券品种之间进行配置。

在类属资产配置层面上，本基金根据市场和类属资产的信用水平，在判断各类属的利率期限结构与国债利率期限结构应具有合理利差水平基础上，将市场细分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债等子市场。结合各类属资产的市场容量、信用等级和流动性特点，在目标久期管理的基础上，运用修正的均值-方差等模型，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

同时，本基金针对债券市场所涉及行业在同样宏观周期背景下不同行业的景气度的情况，通过分散化投资和行业预判进行，具体表现为：1）分散化投资：发行人涉及众多行业，本组合将保持在各行业配置比例上的分散化结构，避免过度集中配置在产业链高度相关的上中下游行业。2）行业投资：本组合将依据对下一阶段各行业景气度特征的研判，确定在下一阶段在各行业的配置比例，卖出景气度降低行业的债券，提前布局景气度提升行业的债券。

## 3、息差策略

本基金将通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，适当运用杠杆息差方式来获取主动管理回报，选取具有较好流动性的债券作为杠杆买入品种，灵活控制杠杆组合仓位，降低组合波动率。

## 4、个券选择策略

在个券选择过程中，本基金将根据市场收益率曲线的定位情况和个券的市场收

益率情况，综合判断个券的投资价值，选择风险收益特征最匹配的品种，构建具体的个券组合。

### 1) 信用债投资策略

在信用债的选择方面，本基金将通过对行业经济周期、发行主体内外部评级和市场利差分析等判断，并结合税收差异和信用风险溢价综合判断个券的投资价值，加强对企业债、公司债等品种的投资，通过对信用利差的分析和管理工作，获取超额收益。

本基金还将利用目前的交易所和银行间两个投资市场的利差不同，密切关注两个市场之间的利差波动情况，积极寻找跨市场中现券和回购操作的套利机会。

### 2) 资产支持证券投资策略

深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用蒙特卡罗方法等数量化定价模型，评估其内在价值，并结合资产支持证券类资产的市场特点，进行此类品种的投资。

### 3) 中小企业私募债券投资策略

针对中小企业私募债券，本基金以持有到期，获得本金和票息收入为主要投资策略，同时，密切关注债券的信用风险变化，力争在控制风险的前提下，获得较高收益。本基金投资中小企业私募债，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，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

## 5、现金头寸管理

由于法律法规限制和开放式基金正常运作的需要，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。其主要用途包括：支付潜在赎回金额、计提管理费和托管费等各类费用的需求、支付交易费用。为有效控制现金留存的影响，基金管理人将采用积极的现金头寸管理手段。具体采用手段包括：

(1) 合理控制现金头寸：根据对申购、赎回、转换等业务和相关费用提留的预判，结合标的指数走势和成份股流动性进行合理的现金留存，最大限度降低现金的

持有比例；

(2) 提升现金头寸收益：在法律法规或市场条件允许的前提下，通过现金权益化的方式降低现金拖累的影响。

#### (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) 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于短期债券的比例不低于非现金资产的 80%；

(2) 本基金保持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%。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(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 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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；

(11) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(12) 本基金投资于中小企业私募债券比例合计不高于基金资产的 10%；

(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值

的 15%；因证券市场波动、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款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（14）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；

（15）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（2）、（10）、（13）、（14）项以外，因证券市场波动、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，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定执行，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）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。

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。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

#### **（五）业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准是：

中国人民银行公布的1年期定期存款利率（税后）

业绩比较基准选择理由：

本基金是债券型基金，主要投资于短期债券，争取基金资产的稳定增值，以中国人民银行公布的1年期定期存款利率（税后）作为业绩比较基准，符合本基金的风险收益特征。

若未来法律法规发生变化，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，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

#### **（六）风险收益特征**

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、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、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；

2、有利于基金财产的安全与增值；

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。

#### **（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。

基金托管人中国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 2020 年 3 月 31 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,041,143,469.36	97.04
	其中：债券	20,814,155,278.10	95.99
	资产支持证券	226,988,191.26	1.05
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	210,934,179.82	0.97
8	其他资产	430,629,880.59	1.99
9	合计	21,682,707,529.77	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。

### 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明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	49,500,000.00	0.25

2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,045,369,672.50	5.27
	其中：政策性金融债	974,423,672.50	4.91
4	企业债券	1,988,549,205.60	10.02
5	企业短期融资券	13,300,671,800.00	67.05
6	中期票据	4,430,064,600.00	22.33
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,814,155,278.10	104.92

### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	012000471	20 中电建设（疫情防控债）SCP001	3,500,000	350,490,000.00	1.77
2	011902881	19 深圳地铁 SCP006	3,000,000	301,830,000.00	1.52
3	011901702	19 船重 SCP006	3,000,000	301,110,000.00	1.52
4	072000001	20 华泰证券 CP001	3,000,000	300,420,000.00	1.51
5	101556048	15 川交投 MTN001	2,500,000	253,950,000.00	1.28

### 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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	159310	G 京投 1 优	2,000,000	193,978,065.23	0.98
2	131922	16 幸福 A5	330,000	33,010,126.03	0.17

### 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国债期货交易情况说明

#### 1.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

### 1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期无国债期货投资。

### 1.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 1.10 投资组合报告附注

### 1.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

中国人民银行于 2020 年 2 月 10 日做出银罚字（2020）23 号处罚决定，由于华泰证券股份有限公司（以下简称“公司”）：1. 未按规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定报送可疑交易报告；3. 与身份不明的客户进行交易。根据相关规定对公司罚款 1010 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 1.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

### 1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	91,375.42
2	应收证券清算款	83,000,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	268,073,776.31
5	应收申购款	79,464,728.86
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	430,629,880.59

### 1.10.4 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。



**1.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

**1.10.6 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（2018年5月16日）至2020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：

平安短债 A

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
2018.5.16-2018.12.31	3.52%	0.03%	0.95%	0.00%	2.57%	0.03%
2019.1.1-2019.12.31	3.59%	0.02%	1.49%	0.00%	2.10%	0.02%
2020.1.1-2020.3.31	1.09%	0.03%	0.37%	0.01%	0.72%	0.02%
自基金合同成立以来	8.41%	0.02%	2.82%	0.00%	5.59 %	0.02%

平安短债 C

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
2018.5.16-2018.12.31	3.46%	0.03%	0.95%	0.00%	2.51%	0.03%
2019.1.1-2019.12.31	3.53%	0.02%	1.49%	0.00%	2.04%	0.02%
2020.1.1-2020.3.31	1.08%	0.02%	0.37%	0.01%	0.71%	0.01%
自基金合同成立以来	8.27%	0.02%	2.82%	0.00%	5.45%	0.02%

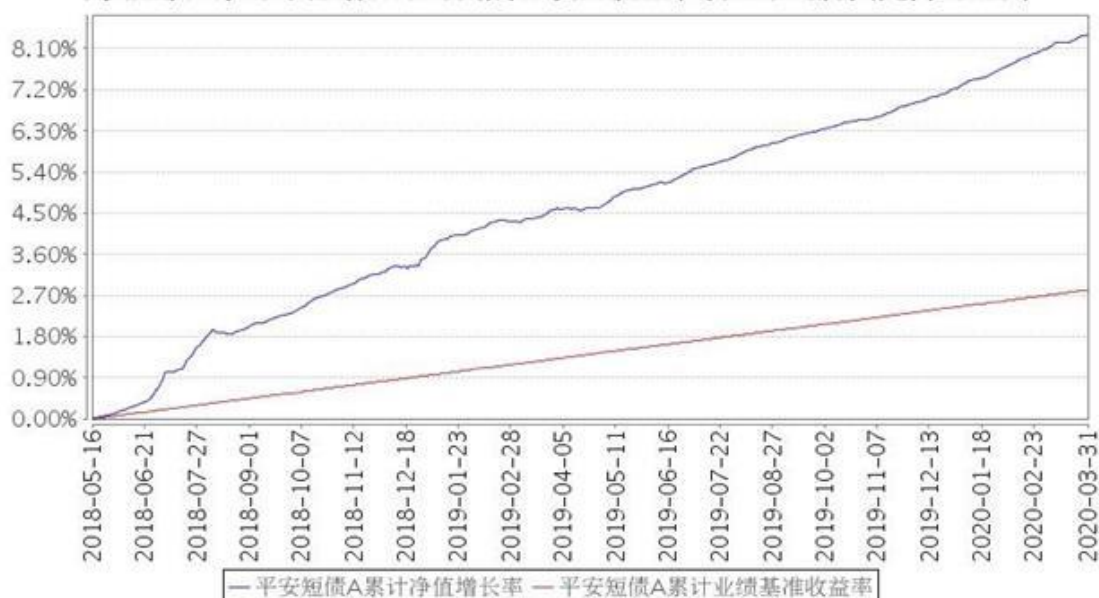
## 平安短债 E

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
2018.5.16-2018.12.31	3.37%	0.03%	0.95%	0.00%	2.42%	0.03%
2019.1.1-2019.12.31	3.36%	0.02%	1.49%	0.00%	1.87%	0.02%
2020.1.1-2020.3.31	1.03%	0.02%	0.37%	0.01%	0.66%	0.01%
自基金合同成立以来	7.94%	0.02%	2.82%	0.00%	5.12%	0.02%

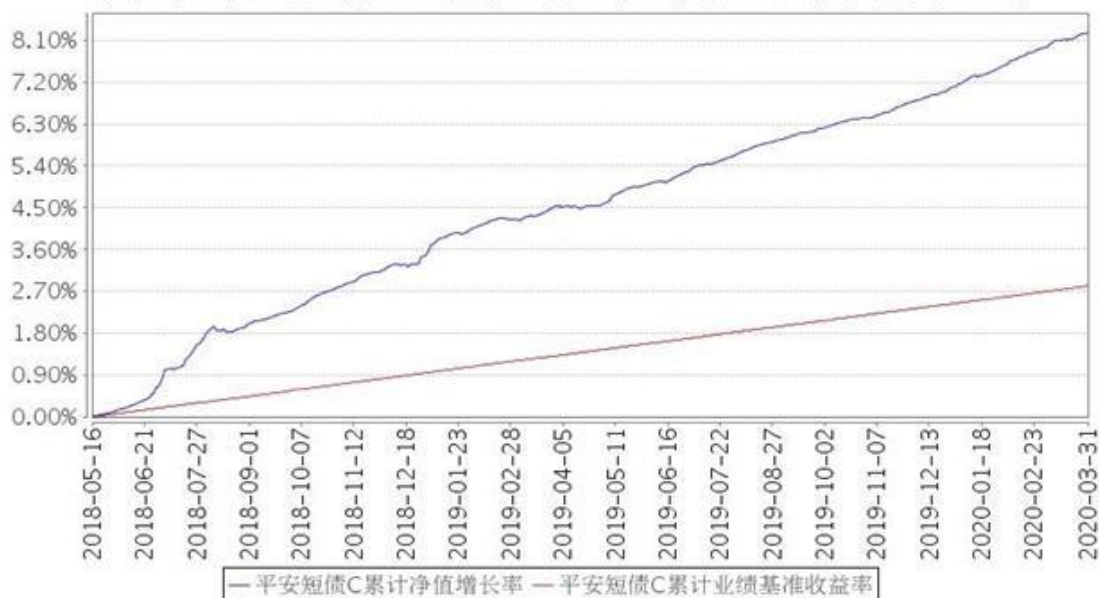
业绩比较基准：中国人民银行公布的 1 年期定期存款利率(税后)

## 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

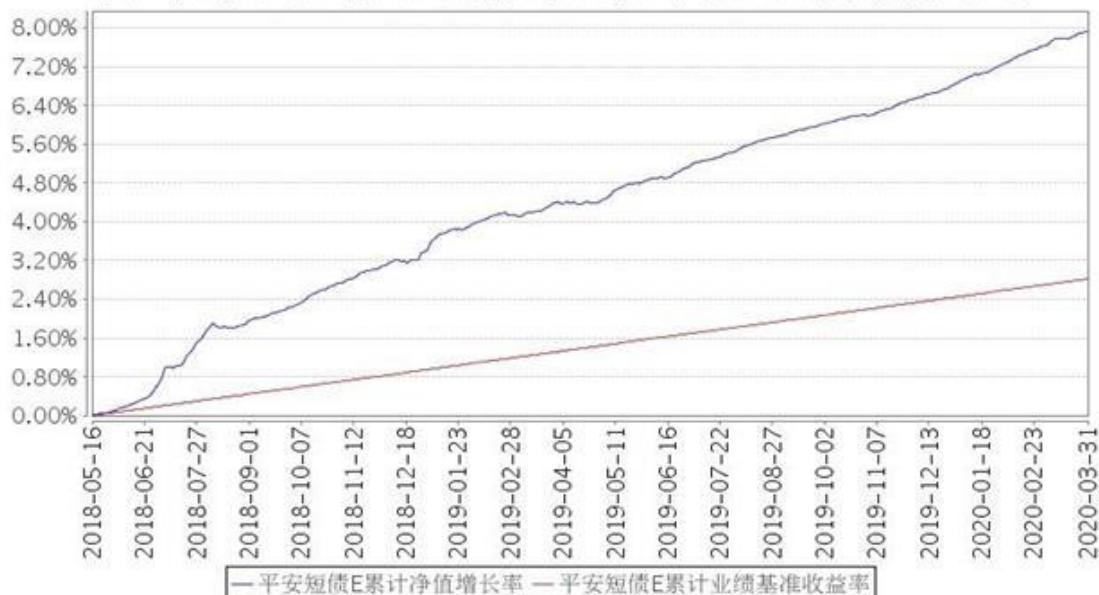
平安短债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安短债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安短债E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于2018年5月16日正式生效；

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，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## 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、本基金C类、E类和I类基金份额计提的销售服务费；
- 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、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的账户开户费用、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0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月第2-5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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月第 2-5 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、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务年费为 0.10%，E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，I 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日 C 类、E 类和 I 类基金资产净值的销售服务年费率计提。计算方法如下： $H=E \times \text{销售服务年费率} \div \text{当年天数}$

H 为 C 类、E 类和 I 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类、E 类和 I 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月第 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

4、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自产品成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于产品成立一个月后的 5 个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

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。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 第十部分 其他应披露事项

本基金2019年5月16日至2020年5月15日发布的公告：

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
2019年6月25日	关于旗下部分基金新增北京百度百盈基金销售有限公司为销售机构的公告
2019年6月28日	平安短债债券型证券投资基金招募说明书更新（2019年第1期）以及摘要
2019年6月28日	关于新增上海华夏财富投资管理有限公司为平安短债债券型证券投资基金销售机构的公告
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
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
2019年7月16日	平安短债债券型证券投资基金2019年第2季度报告
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
2019年8月14日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增喜鹊财富基金销售有限公司为销售机构的公告
2019年8月15日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国平安人寿保险股份有限公司开通转换业务的公告
2019年8月20日	平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告
2019年8月23日	平安短债债券型证券投资基金2019年半年度报告（摘要）
2019年8月23日	平安短债债券型证券投资基金2019年半年度报告
2019年8月26日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西藏东方财富证券股份有限公司为销售机构的公告
2019年8月30日	平安基金管理有限公司关于暂停凤凰金信（银川）基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告
2019年10月25日	平安短债债券型证券投资基金2019年第3季度报告
2019年10月25日	关于旗下部分基金新增浦领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
2019年11月22日	关于平安短债债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告
2019年11月28日	关于旗下5只基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订相关法律文件的公告
2019年11月28日	平安短债债券型证券投资基金招募说明书更新以及摘要（2019年11月）
2020年1月2日	平安基金管理有限公司关于新增华泰证券为平安短债债券型证券投资基金销售机构的公告
2020年1月20日	平安短债债券型证券投资基金2019年第4季度报告



2020 年 2 月 12 日	关于旗下部分基金新增上海云湾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
2020 年 2 月 28 日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构的公告
2020 年 2 月 29 日	平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告
2020 年 3 月 19 日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中金财富证券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
2020 年 3 月 27 日	平安基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告
2020 年 4 月 7 日	平安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换、定投起点及账户最低持有份额下限的公告
2020 年 4 月 20 日	平安短债债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告
2020 年 4 月 23 日	平安基金管理有限公司关于平安短债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告
2020 年 5 月 6 日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信证券华南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
2020 年 5 月 13 日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告

注：其他披露事项详见基金管理人发布的相关公告

## 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》等其他有关法律法规的要求及基金合同的规定，对 2020 年 6 月 24 日公布的《平安短债债券型证券投资基金招募说明书更新》进行了更新，主要更新了 I 类份额的相关内容。

平安基金管理有限公司

2020年8月13日