

# 平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

2020 年 8 月

## 【重要提示】

1、本基金根据2019年1月24日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]141号）进行募集。本基金基金合同生效日为2019年3月5日。

2、基金管理人保证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。

3、投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行负担。

4、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，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券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、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

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。

5、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，但低于混合型基金、股票型基金。

6、本基金的投资范围主要包括债券（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、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、证券公司短期公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款（协议存款、通知存款以及定期存款等）、国债期货、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金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

7、基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，但在每次开放期开始前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；在开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

8、本基金初始面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。

9、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也不构成对本基金业绩表现的保证。

10、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。

11、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。法律法规、监管机构另有规定的，从其规定。

12、基金管理人对本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响，详见招募说明书第十六部分。

13、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。

2020年8月20日，对本招募说明书中的基金经理相关信息进行了更新。本招募说明书所载内容截止日期为2020年2月3日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为2019年12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

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)	出资比例
平安信托有限责任公司	88,647	68.19%
大华资产管理有限公司	22,763	17.51%
三亚盈湾旅业有限公司	18,590	14.3%
合计	130,000	100%

基金管理人无任何重大行政处罚记录。

#### 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，中国香港。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。

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。

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。

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长，新加坡投资管理协会执行委员会委员。历任新加坡政府

投资公司“特别投资部门”首席投资员，大华资产管理有限公司组合经理，国际股票和全球科技团队主管。

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、深圳市龙岗镇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，监事长，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其旗下的富敦资产管理公司以及新加坡毕盛资产公司、鼎崴资本管理公司。于2013年加

入大华资产管理，现任区域总办公室主管。

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监察稽核岗。

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；平安基金管理有限公司人力资源室副经理。

### （3）公司高级管理人员

罗春风先生，1966年生，毕业于东北大学，博士研究生。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，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。

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

张恒先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于华泰证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫基金、景顺长城基金，2015年起在第一创业证券历任投资经理、高级投资经理、投资主办人。2017年11月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资部投资经理。现任平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

(2018-02-02至今)、平安惠安纯债债券型证券投资基金(2018-06-04至今)、平安0-3年期政策性金融债债券型证券投资基金(2019-02-25至今)、平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金(2019-03-05至今)、平安合盛3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019-05-10至今)、平安高等级债债券型证券投资基金(2019-05-29至今)、平安惠添纯债债券型证券投资基金(2019-06-21至今)、平安惠合纯债债券型证券投资基金(2019-12-18至今)、平安元丰中短债债券型证券投资基金(2020-08-03至今)基金经理。

张恒曾管理的基金及管理时间：平安安享保本混合型证券投资基金(2018-02-08至2019-02-14)、平安鑫荣混合型证券投资基金(2018-01-08至2019-01-22)、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金(2018-01-08至2018-07-25)、平安安享灵活配置混合型证券投资基金(2019-02-15至2019-03-13)、平安安心保本混合型证券投资基金(2018-02-08至2019-01-17)、平安大华保本混合型证券投资基金(2018-02-08至2018-10-29)、平安灵活配置混合型证券投资基金(2018-10-30至2019-03-13)、平安惠兴纯债债券型证券投资基金(2018-08-02至2019-09-12)、平安惠融纯债债券型证券投资基金(2018-01-08至2020-01-17)、平安惠锦纯债债券型证券投资基金(2018-10-17至2020-03-09)、平安惠诚纯债债券型证券投资基金(2019-01-31至2020-03-09)、平安惠聚纯债债券型证券投资基金(2019-01-22至2020-03-09)、平安安心灵活配置混合型证券投资基金(2019-01-18至2020-05-25)。

历任基金经理，WANG AO，2019年6月12日至2020年8月20日任本基金基金经理。

### 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。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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、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) 故意损害基金份额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，损害证券投资基金管理人形象；

(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，但是法律法规或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、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，本基金投资则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、尚未依法公开的基本

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、岗位责任、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，报中国证监会相关派出机构认可。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、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：平安银行股份有限公司

注册住所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：广东省深圳市福田区益田路5023号

法定代表人：谢永林

成立日期：1987年12月22日

组织形式：股份有限公司

注册资本：19,405,918,198元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037号

联系人：高希泉

联系电话：(0755) 2219 7701

#### 1、平安银行基本情况

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行，证券代码000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司，于2012年6月吸收合并原平安银行并于同年7月更名为平安银行。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行58%的股份，为平安银行的控股股东。截至2019年末，平安银行有91家分行（含香港分行），共1,058家营业机构。

2019年，平安银行实现营业收入1379.58亿元（同比增长18.2%）、净利润281.95亿元（同比增长13.6%）、资产总额39,390.70亿元（较上年末增长15.2%）、吸收存款余额24,369.35亿元（较上年末增长14.5%）、发放贷款和垫款总额（含贴现）23,232.05亿元（较上年末增长16.3%）。

平安银行总行设资产托管事业部，下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、资金清算处、规划发展处、IT系统支持处、督察合规处、基金服务中心8个处室，目前部门人员为60人。

## 2、主要人员情况

陈正涛，男，中共党员，经济学硕士、高级经济师、高级理财规划师、国际注册私人银行家，具备《中国证券业执业证书》。长期从事商业银行工作，具有本外币资金清算，银行经营管理及基金托管业务的经营管理经验。1985年7月至1993年2月在武汉金融高等专科学校任教；1993年3月至1993年7月在招商银行武汉分行任客户经理；1993年8月至1999年2月在招行武汉分行武昌支行任计划信贷部经理、行长助理；1999年3月—2000年1月在招行武汉分行青山支行任行长助理；2000年2月至2001年7月在招行武汉分行公司银行部任副总经理；2001年8月至2003年2月在招行武汉分行解放公园支行任行长；2003年3月至2005年4月在招行武汉分行机构业务部任总经理；2005年5月至2007年6月在招行武汉分行硚口支行任行长；2007年7月至2008年1月在招行武汉分行同业银行部任总经理；自2008年2月加盟平安银行先后任公司业务部总经理助理、产品及交易银行部副总经理，一直负责公司银行产品开发与管理，全面掌握银行产品包括托管业务产品的运作、营销和管理，尤其是对商业银行有关的各项监管政策比较熟悉。2011年12月任平安银行资产托管部副总经理；2013年5月起任平安银行资产托管事业部副总裁（主持工作）；2015年3月5日起任平安银行资产托管事业部总裁。

## 3、基金托管业务经营情况

2008年8月15日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金管理业务。

截至2019年12月末，平安银行股份有限公司托管证券投资基金净值规模合计3,760.26亿，托管证券投资基金共126只，其中包括华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、招商保证金快线货币市场基金、平安日增利货币市场基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金、平安财富宝货币市场基金、红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华活期添利货币市场证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、鹏华安盈宝货币市场基金、平安新鑫先锋混合型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金。

金、平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、嘉合磐石混合型证券投资基金、平安鑫享混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金、博时裕泰纯债债券型证券投资基金、中海顺鑫保本混合型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金、博时裕景纯债债券型证券投资基金、平安惠盈纯债债券型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、平安安盈保本混合型证券投资基金、嘉实稳盛债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、华润元大现金通货币市场基金、平安鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、南方荣欢定期开放混合型发起式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中海合嘉增强收益债券型证券投资基金、富兰克林国海新活力灵活配置混合型证券投资基金、南方颐元债券型发起式证券投资基金、鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金、鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金、西部利得天添利货币市场基金、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、平安惠享纯债债券型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、博时丰达纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、平安惠利纯债债券型证券投资基金、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金、鹏华丰盈债券型证券投资基金、平安惠隆纯债债券型证券投资基金、平安管家货币市场基金、平安鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、前海开源聚财宝货币市场基金、前海开源沪港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、西部利得汇享债券型证券投资基金、鹏华丰玉债券型证券投资基金、华安睿定期开放混合型证券投资基金、西部利得久安回报灵活配置混合型

证券投资基金、广发汇安18个月定期开放债券型证券投资基金、平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金、南方和元债券型证券投资基金、兴银消费新趋势灵活配置混合型证券投资基金、南方高元债券型发起式证券投资基金、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金、平安惠泽纯债债券型证券投资基金、南方智造未来股票型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安沪深300指数量化增强证券投资基金、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、华夏鼎旺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、博时富安纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金、富荣福锦混合型证券投资基金、前海开源丰鑫灵活配置混合型证券投资基金、平安中证500交易型开放式指数证券投资基金（ETF）、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、平安MSCI中国A股低波动交易型开放式指数证券投资基金（ETF）、平安合悦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、招商添荣3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安中证5-10年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金、人保鑫泽纯债债券型证券投资基金、长江量化匠心甄选股票型证券投资基金、华夏中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、兴业养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、诺德策略精选混合型证券投资基金、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、西部利得添盈短债债券型证券投资基金、华安安平6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中庚价值灵动灵活配置混合型证券投资基金、凯石源混合型证券投资基金、平安季开鑫三个月定期开放债券型证券投资基金、中银康享3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、同泰开泰混合型证券投资基金、鹏华浮动净值型发起式货币市场基金、南方聪元债券型发起式证券投资基金、平安季享裕三个月定期开放债券型证券投资基金、

建信中债5-10年国开行债券指数证券投资基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、嘉实致安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中证800交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信瑞弘三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家惠享39个月定期开放债券型证券投资基金、招商中债-1-3年高等级央企主题债券指数证券投资基金、平安乐顺39个月定期开放债券型证券投资基金。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，平安银行股份有限公司严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管要求，自觉形成守法经营、规范运作的经营理念和经营风格；确保基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益；确保内部控制和风险管理体系的有效性；防范和化解经营风险，确保业务的安全、稳健运行，促进经营目标的实现。

### 2、内部控制组织结构

平安银行股份有限公司设有总行独立一级部门资产托管事业部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

资产托管事业部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；取得基金从业资格的人员符合监管要求；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运

作。利用行业普遍使用的“资产托管业务系统——监控子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## 2、监督流程

- (1) 每工作日按时通过监控子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。
- (2) 收到基金管理人的投资指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。
- (3) 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。
- (4) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### (1) 直销机构

平安基金管理有限公司

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：0755-22627627

传真：0755-23990088

联系人：郑权

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

#### (2) 平安基金网上交易平台

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

联系人：张勇

客服电话：400-800-4800

#### (3) 其他销售机构

##### 1、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](http://www.fund123.cn)

##### 2、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)

3、京东金融-北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院八座15层

法定代表人：江卉

联系人：娄云

电话：4000888816

客服电话：95118

网址：<http://fund.jd.com>

4、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/>

5、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>

6、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](http://www.huaruisales.com)

7、北京百度百盈基金销售有限公司

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/)

8、西藏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：陈宏

联系人：付佳

联系电话：021-23586603

客服电话：95357-8

网址：<http://www.18.cn/>

9、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)

**10、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/>

**11、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/>

**12、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/>

**13、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/>

#### 14、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](http://www.lufund.com)

#### 15、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

联系人：周一涵

联系电话：021-38637436

客服电话：4008816168

传真：0755 -82400862

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

#### 16、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：董旭

联系电话：021-38633116

客服电话：95511 转 1

传真：021-50475630

网址：<http://life.pingan.com>

17、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](http://www.wanhesec.com)

18、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)

19、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：陈东

电话：021-52822063-8301

传真：021-62990063

客服电话：4000-466-788

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

20、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)

21、交通银行股份有限公司

注册地址: 上海市仙霞路 18 号

办公地址: 上海市银城中路 188 号

法定代表人/联系人: 陆志俊

联系人: 张作伟

联系电话: 021-20581740

客户服务电话: 95559

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

22、平安银行股份有限公司

注册住所: 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址: 广东省深圳市福田区益田路 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>

23、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](http://www.cebbank.com)

#### 24、中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

联系电话：010-57092619

客服电话：95568

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

#### 25、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)

#### 26、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](http://www.fundhaiyin.com)

**27、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](http://www.huilinbd.com)

**28、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)

**29、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)

**30、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](http://www.essence.com.cn)

**31、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)

**32、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)

**33、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：陈耀庭

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](http://www.longone.com.cn)

34、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)

35、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](http://www.gjzq.com.cn)

36、华鑫证券有限责任公司

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

法定代表人：俞洋

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

联系人：杨莉娟

业务联系电话：021-54967552

传真电话：021-54967293

网站：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

37、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：南京市江东中路 389 号

法定代表人：步国旬

联系人：王万君

电话：025-58519523

客服电话：95386

网址：[www.njzq.cn](http://www.njzq.cn)

38、申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大

厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大  
厦 20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105

传真：010-88085195

客服电话：4008000562

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

39、申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼

办公地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 40 楼

法定代表人：李梅

联系人：李玉婷

联系电话：021-33388229

客服电话：95523 或 4008895523

传真：021-33388224

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

#### 40、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：王雯

电话：0755-83199511

客服电话：4008323000

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

#### 41、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>

#### 42、西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

联系人：张煜

电话：023-63786633

客服电话：95355、400-8096-096

传真：023-63786212

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

#### 43、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](http://www.cindasc.com)

#### 44、英大证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：吴骏

联系人：吴尔晖

电话：0755-83007159

传真：0755-83007034

客服电话：400-018-8688

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

#### 45、粤开证券股份有限公司

注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视台新闻中心西面一层大堂和

三、四层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人：严亦斌

联系人：彭莲

联系电话：0755-83331195

客户服务电话：95564

公司网址：<http://www.ykzq.com>

#### 46、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)

#### 47、长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

联系电话：021-68751860

客服电话：95579 或 4008-888-999

传真：027-85481900

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

#### 48、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](http://www.chinastock.com.cn)

#### 49、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](http://www.zts.com.cn)

## 50、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

客服电话：400-8888-108

传真：010-65182261

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

## 51、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](http://sd.citics.com)

## 52、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](http://www.cs.ecitic.com)

如果本基金后续调整销售机构的，详见基金管理人刊登的关于本基金调整销售机构的公告或在基金管理人网站披露的基金销售机构名录。

销售机构在各销售城市的销售网点及联系方式等具体事项详见各销售机构的相关公告。

## 二、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：罗春凤

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：021-31358666

传真：021-31358600

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、邓昭君

## 第四部分 基金的名称

平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金

## 第五部分 基金的类别

债券型证券投资基金

## 第六部分 基金的运作方式

契约型、定期开放式

基金以每个封闭期为周期进行投资运作，在每个封闭期内不开放申购、赎回业务，也不上市交易，仅在开放期内开放申购、赎回业务。

开放期：每个开放期的首个开放日指每年 1 月 10 日、4 月 10 日、7 月 10 日及 10 月 10 日（包括该日），若上述日期为非工作日，则首个开放日为该非工作日的下一工作日。

本基金每个开放期最长不超过 15 个工作日，最短不少于 1 个工作日，如封闭期结束后或在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回等业务的，或依据基金合同需暂停申购或赎回等业务的，开放期时间顺延，直到满足开放期的时间要求，开放期的具体时间由基金管理人在每个开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。

封闭期：每相邻两个开放期之间运作时段为一个封闭期，即每个开放期结束后的次日至下一个开放期的首个开放日的前一日。本基金首个封闭期为自基金合同生效日起（包括基金合同生效之日）至最近一个开放期的首个开放日前一日。

## 第七部分 基金的投资

### 一、投资目标

在谨慎控制组合净值波动率的前提下，本基金追求基金产品的长期、持续增值，并力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

### 二、投资范围

本基金的投资范围主要包括债券（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、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、证券公司短期公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款（协议存款、通知存款以及定期存款等）、国债期货、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，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。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；在开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除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，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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 三、投资策略

本基金通过对宏观经济周期、行业前景预测和发债主体公司研究的综合运用，主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略，在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上，深入挖掘价值被低估的固定收益投资品种，构建及调整固定收益投资组合。

本基金将灵活应用组合久期配置策略、类属资产配置策略、个券选择策略、息差策略、现金头寸管理策略等，在合理管理并控制组合风险的前提下，获得债

券市场的整体回报率及超额收益。

### 封闭期投资策略：

#### 1、资产配置策略

本基金在资产配置层面主要通过对宏观经济变量（包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）、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。在此基础上，确定资产在非信用类固定收益类证券（现金、国家债券、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例，整体组合的久期范围以及杠杆率水平。

同时，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，以期增强基金资产的获利能力。

#### 2、债券投资策略

##### (1) 组合久期配置策略

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。根据操作，具体包括跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

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的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，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) 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。

#### 3) 证券公司短期公司债券投资策略

本基金可根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。此外，由于证券公

司短期公司债券整体流动性相对较差，本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资，保证本基金的流动性。

### 3、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，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，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债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国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债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。

### 4、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面因素，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。

### 开放期投资策略：

开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。

## 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%，但在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受此比例限制；

(2) 在开放期内，本基金每个交易日日终每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但

每个交易日日终在扣除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，前述现金不包括结算备付金、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，债券回购到期后不得展期；

(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) 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%，且投资中小企业私募债券的剩余期限，不得超过当期的剩余封闭期；

(12) 封闭期内基金总资产不得超过基金净资产的 200%，开放期内基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(13) 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；

(14) 本基金参与国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金

持有的债券总市值的 30%;

3) 本基金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%;

4) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、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例的有关约定；

(15) 开放期内，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、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；

(16) 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）、（15）项外，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，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

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按调整后的规定执行。

## 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) 向其基金管理人、基金托管人出资；

(5) 买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；

(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

中债综合财富（总值）指数收益率 $\times$ 90%+1年期定期存款利率（税后） $\times$ 10%。

本基金选择上述业绩比较基准的原因为本基金是通过债券资产的配置和个券的选择来增强债券投资的收益。中债综合财富（总值）指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。指数涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性，适合作为市场债券投资收益的衡量标准；由于本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，持有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%，采用90%作为业绩比较基准中债券投资所代表的权重，10%作为现金资产所对应的权重可以较好的反映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，但低于混合型基金、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

基金管理人在代表基金行使所投资证券项下权利时应遵守以下原则：

- 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、基金投资组合报告

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12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	2,795,549,077.70	97.61
	其中：债券	2,730,549,077.70	95.34
	资产支持证券	65,000,000.00	2.27
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	26,300,979.99	0.92
8	其他资产	42,113,381.02	1.47
9	合计	2,863,963,438.71	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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	207,779,000.00	11.02
	其中：政策性金融债	61,130,000.00	3.24
4	企业债券	879,994,577.70	46.66
5	企业短期融资券	512,203,000.00	27.16
6	中期票据	1,043,740,500.00	55.34
7	可转债(可交换债)	—	—
8	同业存单	86,832,000.00	4.60
9	其他	—	—
10	合计	2,730,549,077.70	144.78

### 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	1980341	19成产业债01	1,000,000	100,900,000.00	5.35
2	111995268	19盛京银行CD188	900,000	86,832,000.00	4.60
3	112307	15投资01	800,000	79,976,000.00	4.24
4	101901551	19天津港MTN001	700,000	70,518,000.00	3.74
5	041900386	19滇池投资CP001	600,000	60,138,000.00	3.19

### 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

#### 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	138117	信借03A	500,000	50,000,000.00	2.65
2	NTZH05	招慧05A	150,000	15,000,000.00	0.80

### 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**

本基金本报告期末无国债期货投资。

### **1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无国债期货投资。

### **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**

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。

### **1.10.2**

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	110,214.08
2	应收证券清算款	3,193,027.00
3	应收股利	—
4	应收利息	38,810,139.94
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	42,113,381.02

### **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（2019年3月5日）至2019年12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：

平安季添盈 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
2019.3.5-2019.12.31	3.95%	0.03%	3.50%	0.04%	0.45%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.95%	0.03%	3.50%	0.04%	0.45%	-0.01%

平安季添盈 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
2019.10.21-2019.12.31	1.18%	0.03%	1.11%	0.04%	0.07%	-0.01%
自基金合同生效起至今	1.18%	0.03%	1.11%	0.04%	0.07%	-0.01%

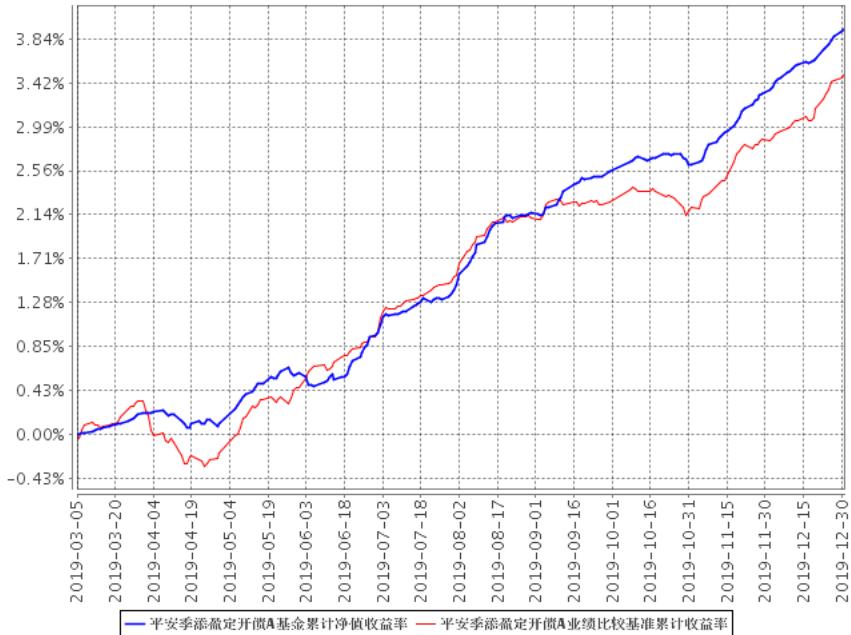
平安季添盈 E

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
2019.3.5-2019.12.31	3.73%	0.03%	3.50%	0.04%	0.23%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.73%	0.03%	3.50%	0.04%	0.23%	-0.01%

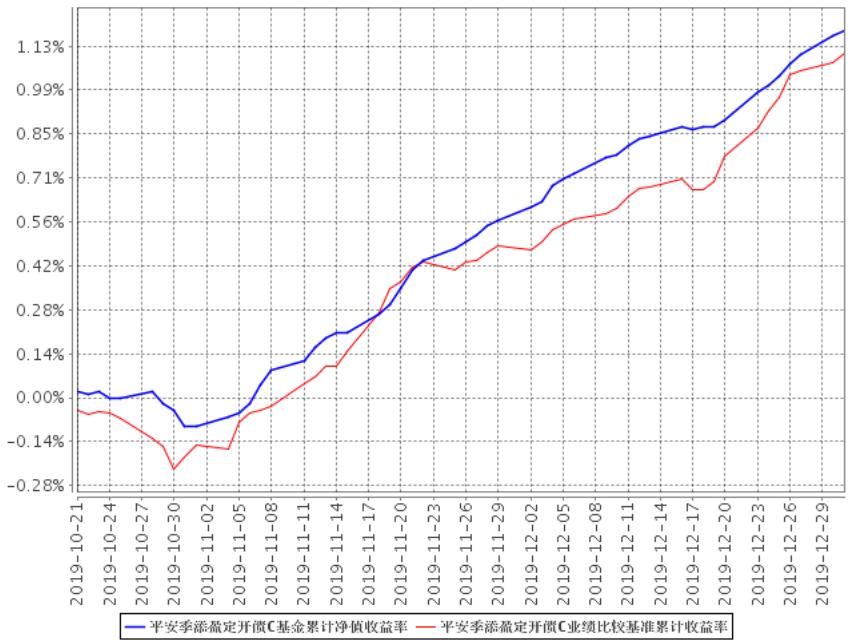
业绩比较基准：中债综合财富(总值)指数收益率\*90%+1年期定期存款利率(税后)\*10%

## 二、自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率比较：

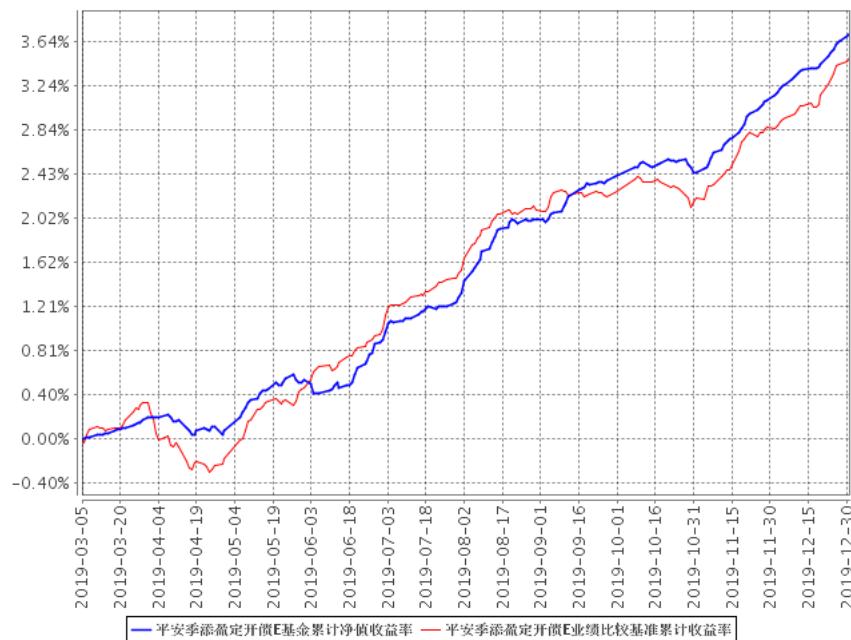
平安季添盈定开债A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安季添盈定开债C基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安季添盈定开债E基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2019 年 03 月 05 日正式生效，截至报告期末未满一年；
- 2、季添盈 C 类份额自基金合同生效以来指 2019 年 10 月 21 日至 2019 年 12 月 31 日；
- 3、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、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用（包括但不限于场地费、会计师费、律师费和公证费）；
- 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，基金托管人按与基金管理人协商一致的方式于次月前 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、公休日等，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，基金托管人按与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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率年率为 0.25%。计算方法如下：

$H = E \times C$  类、E 类基金份额对应的销售服务年费率 ÷ 当年天数

H 为 C 类、E 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类、E 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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首日起 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。

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

本基金自2019年3月5日至2020年2月3日发布的公告：

2019年3月6日	关于平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告
2019年3月12日	关于旗下部分基金新增华瑞保险销售有限公司为销售机构的公告
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
2019年4月8日	关于平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告
2019年4月9日	关于新增中国平安人寿保险股份有限公司为平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金E类份额销售机构的公告
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
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
2019年5月14日	关于新增包商银行股份有限公司为销售机构的公告
2019年6月13日	平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告
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1日	关于平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告
2019年7月4日	关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构的公告
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15日	平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金2019年第2季度报告
2019年7月31日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行股份有限公司为销售机构的公告
2019年8月8日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增珠海盈米基金销售有限公司为销售机构的公告
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22日	平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金2019年半年度报告（摘要）
2019年8月22日	平安季添盈三个月定期开放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劵股份有限公司为销售机构的公告
2019年9月25日	关于平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告
2019年10月24日	平安季添盈三个月定期开放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	关于旗下部分基金新增万和证券股份有限公司为销售机构公告
2019年11月29日	关于旗下部分基金新增海银基金销售有限公司为销售机构及开通转换业

	务并参与其费率优惠的公告
2019年12月3日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增英大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
2019年12月4日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增交通银行股份有限公司为销售机构的公告
2019年12月4日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增长城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
2019年12月4日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信建投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
2019年12月25日	关于光大银行股份有限公司新增代销平安基金管理有限公司旗下开放式基金的公告
2019年12月26日	关于旗下10只基金根据《公开募集证券投资基金管理办法》修订相关法律文件的公告
2019年12月26日	平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书更新（摘要）
2019年12月26日	平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同
2019年12月26日	平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书更新
2019年12月26日	平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议
2019年12月28日	关于平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告
2019年12月31日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量基金销售有限公司为销售机构的公告
2020年1月3日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信银行股份有限公司为销售机构的公告
2020年1月9日	平安基金管理有限公司关于新增民生银行为平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金销售机构的公告
2020年1月17日	平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金2019年第4季度报告

（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

依据《中华人民共和国证券投资基金法》等其他相关法律法规的要求及基金合同的规定，对2020年3月4日公布的《平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书更新》进行了更新，本次主要是对“基金管理人”中基金经理信息进行了更新。

平安基金管理有限公司

2020 年 8 月 21 日