

(上接 C33 版)

(76) 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 (77) 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

2. 基金管理人可根据有关法律、法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构,并及时公告。 二、注册登记机构 平安大华基金管理有限公司 注册地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层 办公地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层 法定代表人:罗春风 电话:0755-22624581 传真:0755-23990088 联系人:张平

三、出具法律意见书的律师事务所 律师事务所:上海市通力律师事务所 地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼 负责人:俞卫锋 电话:021-3135 8666 传真:021-3135 8600 经办律师:黎明、陈颖华 联系人:陈颖华 四、审计基金财产的会计师事务所 会计师事务所:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 住所:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼 办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼 法定代表人:李丹 联系电话:(021)2323 8888 传真电话:(021)2323 8800 经办注册会计师:曹翠丽、陈怡 联系人:陈怡

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金 基金名称 第五部分 基金的投资 股票型证券投资基金 第六部分 基金的运作方式 契约型开放式 第七部分 基金的投资 一、投资目标 本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证沪港深高股息精选指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。 二、投资范围 本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中概股、创业板及其他经中国证监会核准上市交易的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例: 本基金90%以上的基金资产投资于股票。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 本基金参与股指期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。 如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。 三、投资策略 本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。 本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 (一)资产配置策略 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将主要投资于标的指数成份股和备选成份股。原则上本基金将采用指数复制法,按标的指数的成份股权重构建组合。特殊情况下,本基金将配合使用优化方法作为补充,以保证对标的指数的有效跟踪。 (二)股票投资策略 本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资,根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合,并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。 1. 股票投资组合的构建 本基金在建仓期内,将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法,以降低买入成本。特殊情况下,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,对基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。 2. 股票投资组合的调整 (1)定期调整 本基金所构建的指数化投资组合将定期跟踪所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。 (2)不定期调整 1)当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据指数公司发布的临时调整决定及其需调整的股权比例,进行相应调整; 2) 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数; 3) 特殊情况下,如基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。 上述特殊情况包括但不限于以下情形:①法律法规的限制;②标的指数成份股长期停牌;③标的指数成份股流动性严重不足;④成份股上市公司存在重大违规行为,有可能面临重大的处罚或诉讼。 (三)债券投资策略 债券投资策略方面,本基金在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境分析方面,结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的

综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定不同类属资产的最优权重。 在微观市场定价分析方面,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。 (四)权证投资策略 本基金将权证的投资作为提高投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究结果确定权证的合理价值,发现市场对股票权证的非理性定价;利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,来达到改善组合风险收益特征的目的。 (五)股指期货投资策略 本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品进行杠杆操作,以达到降低投资组合的整体风险的目的。 (六)资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。 (七)中小企业私募债券投资策略 本基金将通过中小企业私募债券发行信用评级控制,通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制,严格控制跟踪风险,对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估,并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响,通过信用研究和流动性管理后,决定投资品种。 基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。 四、投资限制 1. 组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制: (1)本基金90%以上的基金资产投资于股票; (2) 本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%; (3) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等; (4) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%; (5) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%; (6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%; (7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券的10%; (8) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%; (9) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%; (10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%; (11) 本基金投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出; (12) 基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量; (13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%; (14) 在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定; (15) 本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过本基金资产净值的10%; (16) 基金资产总值不得超过基金资产净值的140%; (17) 本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议或其他基金管理人及基金托管人书面合同中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险; (18) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资; (19) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致; (20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除上述第(3)、(11)、(18)、(19)项外,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组合不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。 如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制,但须提前公告,不需要经基金份额持有人大会审议。 2. 禁止行为 为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或活动: (1)承销证券; (2)违反规定向他人贷款或者提供担保; (3)从事承担无限责任的投资; (4)向基金管理人、基金托管人出资; (5)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动; (6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。 法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或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,并经三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应当至少每半年对关联交易事项进行审查。

五、业绩比较基准

1. 本基金的标的指数:中证沪港深高股息精选指数,及其未来可能发生的变更。 中证沪港深高股息精选指数从沪深A股以及符合港股通条件的港股中选取100只流动性好、连续分红、股息率高、盈利持续且具有成长性股票作为指数样本,采用股息率加权,以反映沪港深三地市场股息率高、盈利持续且具有成长性的股票的整体表现。 如果指数编制单位变更或停止中证沪港深高股息精选指数的编制、发布或授权,或中证沪港深高股息精选指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致中证沪港深高股息精选指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,变更本基金的标的指数。若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,报中国证监会备案并在指定媒介公告。若标的指数变更对基金投资组合变更、指数更名等,则无需召开基金份额持有人大会,在报中国证监会备案后及时公告。 2. 本基金业绩比较基准: 中证沪港深高股息精选指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5% 本基金选择该业绩基准,是基于以下因素: 1. 中证沪港深高股息精选指数由中证指数有限公司发布,反映了沪港深三地市场股息率高、盈利持续且具有成长性的股票的整体表现。 2. 活期存款利率由中国人民银行公布,具有广泛的知名度和市场影响力; 3. 本基金的各投资标的的比例,选用该业绩比较基准能够真实反映本基金的风险收益特征。 若本基金标的指数发生变更,基金业绩比较基准随之变更。若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,报中国证监会备案并在指定媒介公告。若标的指数变更对基金投资组合变更、指数更名等,则无需召开基金份额持有人大会,在报中国证监会备案后及时公告。 六、风险收益特征 本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金还将投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法 1. 有利于基金资产的安全与增值; 2. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利,保护基金份额持有人的利益; 3. 不涉及关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利益冲突的第三方牟取任何不当利益; 4. 不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理。 八、其他 1. 基金的转型 若将来基金管理人推出以中证沪港深高股息精选指数为标的指数的交易型开放式指数基金(ETF),本基金由基金管理人和基金托管人协商一致后可相应调整为该交易型开放式指数基金(ETF)的联接基金模式并对投资运作等相关内容进行调整,届时无需召开基金份额持有人大会,但需报中国证监会变更注册或备案并提前公告。 联接基金是指绝大部分基金资产投资于同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF),以紧密跟踪标的指数的交易型开放式指数基金(ETF)为业绩比较基准的基金。 九、投资组合报告 基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。 基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 本报告投资组合数据截至2018年6月30日,本财务报表数据未经审计。 1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 权益投资, 其中:股票, 2 基金投资, 3 固定收益投资, 其中:债券, 资产支持证券, 4 贵金属投资, 5 金融衍生品投资, 6 买入返售金融资产, 7 银行存款和结算备付金合计, 8 其他资产, 9 合计.

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 1.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include A 农林牧渔, B 采矿业, C 制造业, D 电力、热力、燃气及水生产和供应业, E 建筑业, F 批发和零售业, G 交通运输、仓储和邮政业, H 住宿和餐饮业, I 信息技术, J 金融业, K 房地产业, L 租赁和商务服务业, M 科学研究和技术服务业, N 水利、环境和公共设施管理业, O 居民服务、修理和其他服务业, P 教育, Q 卫生和社会工作, R 文化、体育和娱乐业, S 综合, 合计.

1.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合 本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。 1.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

组合

Table with 4 columns: 行业类别, 公允价值(人民币), 占基金资产净值比例(%). Rows include A 基础材料, B 消费者非必需品, C 消费者必需品, D 能源, E 金融, F 医疗保健, G 工业, H 信息技术, I 电信服务, J 公用事业, K 房地产, 合计.

1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 1.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1 000895 双汇发展, 2 01382 互太纺织, 3 00868 信义玻璃, 4 600660 福耀玻璃, 5 000733 耀华国际, 6 002372 伟星新材, 7 01999 敏华控股, 8 0017 江苏宁沪高速, 9 02020 安踏体育, 10 00551 裕元集团.

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

Table with 5 columns: 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(%). Row include 1 00001 长虹, 500, 35,027.96, 0.23.

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 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 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 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 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 1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策 1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

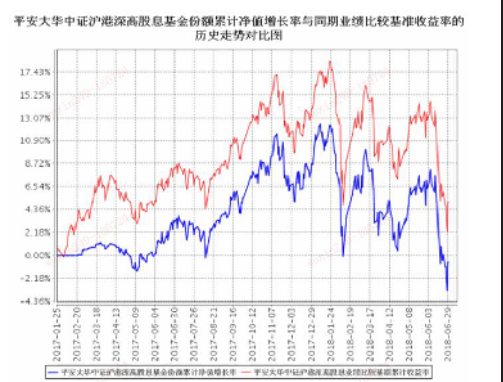
1.10.1 本期国债期货投资政策 1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 1.10.3 本期国债期货投资评价 1.10.4 报告期末无股指期货投资。 1.11 投资组合报告附注 1.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。 1.11.2 基金投资的前十名股票没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。 1.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1 存出保证金, 1,530.63, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 50,139.83, 4 应收利息, 181.70, 5 应收申购款, 10,304.43, 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他, 9 合计, 61,956.59.

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 1.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 1.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明 1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。 第八部分 基金的业绩 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者的过往业绩并不能代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。 一、自基金合同生效以来(2017年1月25日)至2018年6月30日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

Table with 6 columns: 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. Rows include 2017.1.25-2017.6.30, 2017.7.1-2017.12.31, 2018.1.1-2018.6.30, 自基金合同生效至今.

业绩比较基准: 中证沪港深高股息精选指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5% 二、自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1. 本基金基金合同于2017年1月25日正式生效,截至报告期末已满一年; 2. 按照本基金之基金合同规定,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。 第九部分 基金的费用与税收 一、基金费用的种类 1. 基金管理人的管理费; 2. 基金托管人的托管费; 3. 基金管理人向标的指数供应商商订的相应指数许可协议约定的指数使用许可费; 4. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用; 5. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、诉讼费和其他费用; 6. 基金份额持有人大会费用; 7. 基金的申购、赎回交易费用; 8. 基金的银行汇划费用; 9. 基金的开户费用、账户维护费用; 10. 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1. 基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×1.0%÷当年天数 H为每日应计提的基金管理费 E为前一日基金资产净值 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人的基金托管人于次月首日起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、公休假或不同抗力等,支付日期顺延。 2. 基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下: H=E×0.20%÷当年天数 H为每日应计提的基金托管费 E为前一日基金资产净值 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假或不同抗力等,支付日期顺延。 三、基金业绩报酬 基金管理人按照基金管理人向标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法从基金财产中一次性支付使用许可费。指数使用许可费的计算方法如下: H=E×0.02%÷当年天数 H为每日计提的指数使用许可费 E为前一日资产净值 自基金成立的下一季度(自然季度)起,指数使用许可费收取下限为每季度(自然季度)15万元,即不足5万元时按照5万元收取,基金成立日所在季度,若按规模计提的指数使用许可费超过5万元,则按实际天数计提;若按规模计提的指数使用许可费不足5万元,则: 指数使用许可费=每日资产净值×基金资产净值×基金资产净值×指数使用许可费率,逐日累计,按季度支付。 基金管理人应于每个季度(自然季度)结束后10个工作日内与标的指数许可方结算该季度的指数使用许可费。 如果指数使用许可协议约定的指数使用许可费的计算方法、费率及支付方式等发生变更,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用许可费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。 上述“一、基金费用的种类”中第4—10项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。 三、列入基金费用的项目 1. 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失; 2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用; 3. 《基金合同》生效前的相关费用; 4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。 四、基金税收 本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。 第十部分 其他应披露事项 (一) 本基金管理人、基金托管人目前无重大诉讼事项。 (二) 最近半年本基金管理人、基金托管人及高级管理人员没有受到任何处罚。 (三) 2018年1月25日至2018年7月24日发布的公告: 1. 2018年1月26日,关于平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金修订托管协议的公告; 2. 2018年2月6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; 3. 2018年2月27日,平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金招募说明书更新(2018年第一期)以及摘要; 4. 2018年3月24日,关于平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金修改基金合同的公告; 5. 2018年3月26日,平安大华基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金赎回费率的公告; 6. 2018年3月28日,关于平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金经理变更公告; 7. 2018年3月29日,平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2017年年度报告以及摘要; 8. 2018年3月30日,关于旗下部分基金新增中民财富基金销售有限公司为销售机构的公告; 9. 2018年3月16日,关于旗下部分基金新增海银基金销售有限公司并开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告; 10. 2018年4月20日,平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2018年1季度报告; 11. 2018年5月18日,关于旗下部分基金新增上海大智慧基金销售有限公司为销售机构的公告; 12. 2018年5月29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的公告; 13. 2018年6月13日,关于旗下部分基金新增济安财富(北京)基金销售有限公司为销售机构的公告; 14. 2018年7月18日,平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2018年2季度报告; 15. 2018年7月19日,关于新增蚂蚁(杭州)销售有限公司为销售机构并开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告; 16. 2018年7月20日,关于旗下部分基金新增中证金牛(北京)投资咨询有限公司为销售机构的公告; (四) 招募说明书与本次更新的招募说明书内容若有一致之处,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说明 依据《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规的规定,对2018年2月27日公布的《平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金招募说明书(更新)2018年第一期》进行了更新,主要更新的内容如下: 1. 根据最新资料,更新了“重要提示”部分; 2. 根据最新资料,更新了“第二部分、绪言”部分; 3. 根据最新资料,更新了“第二部分、释义”部分; 4. 根据最新资料,更新了“第三部分、基金管理人”; 5. 根据最新资料,更新了“第四部分、基金托管人”; 6. 根据最新资料,更新了“第五部分、相关服务机构”; 7. 根据最新资料,更新了“第八部分、基金份额的申购与赎回”; 8. 根据最新资料,更新了“第九部分、基金的投资”; 9. 根据最新资料,更新了“第十部分、基金的业绩”; 10. 根据最新资料,更新了“第十一部分、基金资产的估值”; 11. 根据最新资料,更新了“第十六部分、基金的信息披露”; 12. 根据最新资料,更新了“第十七部分、风险揭示”; 13. 根据最新资料,更新了“第二十部分、托管协议的内容摘要”; 14. 根据最新资料,更新了“第二十一部分、对基金份额持有人的服务”; 15. 根据最新资料,更新了“第二十二部分、其他应披露的事项”; 16. 根据最新情况,更新了“第二十三部分、对招募说明书更新部分的说明。 平安大华基金管理有限公司 2018年8月17日