

(上接 C35 版)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、鹏华弘腾灵活配置混合型证券投资基金、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、平安大华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、平安大华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、平安大华惠利纯债债券型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、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、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠利纯债债券型证券投资基金、广发鑫盛18个月定期开放混合型证券投资基金、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、平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金、平安大华金管家货币市场基金、平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国联安睿定开混合型证券投资基金、华泰柏瑞季享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、平安新安安灵活配置混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、前海开源聚财货币市场基金、招商稳阳定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长盛盛理灵活配置混合型证券投资基金、前海开源沪港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、西部利得享债债券型证券投资基金、鹏华丰玉债券型证券投资基金、平安睿安定期开放混合型证券投资基金、西部利得久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、上投摩根岁岁定期开放债券型证券投资基金、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金、南方和元债券型证券投资基金、中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金、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、中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金、中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金、平安大华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、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安大华沪深300指数量化增强证券投资基金、平安大华合正定期开放纯债债券型证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、华夏聚旺3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金、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、富荣福鑫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、平安大华中证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、平安大华合正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、平安大华MSCI中国A股低波动交易型开放式指数证券投资基金(ETF)、平安大华合悦定期开放债券型发起式证券投资基金。

二、基金投资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督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；业务管理严格执行复核、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；业务信息与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—监控系统”，严格按照相关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) 每日工作日报时通过监控系统，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
 平安大华基金管理有限公司
 办公地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心34层
 法定代表人：罗春风
 电话：0755-22621438
 传真：0755-23990088
 联系人：郑斌
 网址：www.fund.pingan.com
2. 注册登记机构
 平安大华基金管理有限公司
 注册地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心34层
 办公地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心34层
 法定代表人：罗春风
 电话：0755-22624581
 传真：0755-23998639
 联系人：张平
三、出具法律意见书的律师事务所
 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
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

第四部分 基金的名称
第五部分 基金的类型
 债券型发起式证券投资基金

第六部分 基金的运作方式
 契约型，定期开放方式运作。

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债部分、债券回购、银行存款(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，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的债部分除外)、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，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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。
 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，主要通过宏观利率策略、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。
 本基金将灵活运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、国债、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，对各类债券进行久期配置；当收益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。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、杠杠策略及梯式策略。
(2) 类属资产配置策略
 根据不同债券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，利率变动情况，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，判断各个债券类别的预期持有期回报，在不同债券品种之间进行配置。
(3) 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行业，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中上下游行业。
 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，本基金将通过对比行业经济周期、发行主体内部信用评级和市场利率分析等判断，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判断，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，积极寻找跨市场中利差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. 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，评估其在价值，并结合资产支持证券类资产的资产特点，进行此类品种的投资。

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%，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。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制；
 (3) 本基金持有单家公司发行的证券，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单家公司发行的证券，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。本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) 本基金投资于中小企业私募债券比例合计不超过基金资产的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%，开放期内基金总资产不得超过基金净资产的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) 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；
 (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组合不符合上述规定比例的，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上述限制，如适用于本基金，基金管理人可在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或调整后的规定执行，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或者；
 (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
 (5) 买卖其他基金份，但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益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

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，基金管理人可在履行适当程序后，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为：中债综合指数(总财富)
 本基金属于债券基金，应采用债券指数未做业绩比较基准。选择上述业绩比较基准的原因是中债综合指数(总财富)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基准。
 若未来法律法规发生变化，或有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场发生重大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
 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法律责任。
 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。
 本投资报告所载数据截至2018年6月30日，本财务报表未经审计。

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	2,000,420,100.00	97.81
	其中：债券	2,000,420,100.00	97.81
	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	-	-
	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	3,584,216.09	0.18
8	其他资产	41,227,740.65	2.02
9	合计	2,045,232,056.74	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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债	301,744,100.00	19.94
5	企业短期融资券	701,131,000.00	46.33
6	中期票据	700,666,000.00	46.29
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	296,939,000.00	19.62
9	其他	-	-
10	合计	2,000,420,100.00	132.18

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	041800185	18 华农实债 CP001	1,000,000	100,990,000.00	6.61
2	101800563	18 华农高票 MTN003	1,000,000	99,850,000.00	6.60
3	101769018	17 鲁国债 MTN002	900,000	90,207,000.00	5.96
4	011800916	18 中债资本 SCP001	900,000	90,153,000.00	5.96
5	101800570	18 华农高票 MTN001	800,000	80,632,000.00	5.33

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
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。
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
 本基金本报告期末未持有权证。
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交易。
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 本基金本报告期末未持有国债期货交易。
1.9.3 本期国债期货投资评价
 本基金本报告期末无国债期货交易。
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	6,744.10
2	应收证券清算款	14,947,957.75
3	应收股利	-
4	应收利息	26,273,038.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,227,740.65

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
 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。
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。

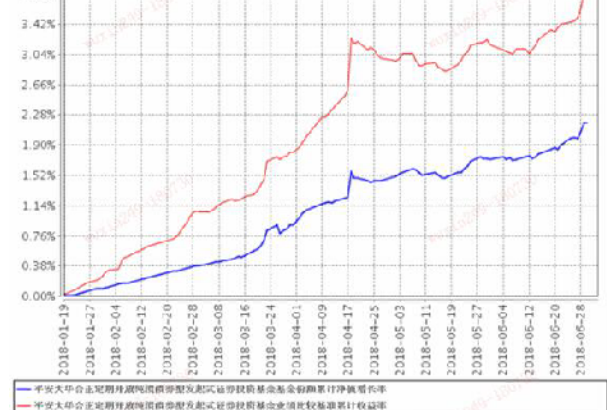
一、自基金合同生效以来(2018年1月19日)至2018年6月30日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准增长率②	业绩比较基准标准差③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
自基金合同生效以来	2.18%	0.04%	3.80%	0.08%	-1.62%	-0.04%

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数(总财富)
 二、自基金合同生效以来基金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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金份额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1月19日正式生效，截至报告期末已满半年；

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六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. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
 4. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、诉讼费和仲裁费；
 5. 基金份额持有人大会费用(包括但不限于场地费、会计师费、律师费和公证费)；
 6. 基金的证券交易费用；
 7. 基金的银行汇划费用；
 8. 基金的账户开户费用、账户维护费用；
 9. 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：
 $H = E \times 0.30\% \times \text{当年天数}$
 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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，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：
 $H = E \times 0.10\% \times \text{当年天数}$
 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取。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3-9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。
 基金投资资产的相关税收，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

(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19日至2018年7月18日发布的公告：
 1、2018年1月20日，关于平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告；
 2、2018年2月3日，平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告；
 3、2018年4月14日，关于平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告；
 4、2018年4月20日，平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金2018年1季度报告；
 5、2018年6月20日，平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金分红公告；
 6、2018年7月18日，平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金2018年第2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》等相关法律法规的规定，对2018年1月12日公布的《平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》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“第三部分、基金管理人”。
 3. 根据最新资料，更新了“第四部分、基金托管人”。
 4. 根据最新资料，更新了“第五部分、相关服务机构”。
 5. 根据最新资料，更新了“第六部分、基金募集”。
 6. 根据最新资料，更新了“第七部分、基金合同的生效”。
 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，增加了“第十部分、基金的业绩”。
 10. 根据最新资料，更新了“第十七部分、风险揭示”。
 11. 根据最新资料，更新了“第二十二部分、对基金份额持有人的服务”。
 12. 根据最新资料，更新了“第二十二部分、其他应披露的事项”。
 13. 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