

## 平安中证500指数增强型发起式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:中国银行股份有限公司  
二零二零年六月  
重要提示

平安中证500指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2019年10月29日证监许可[2019]2064号文注册。  
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。投资者投资于本基金在极端情况下可能损失全部本金。  
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。本基金投资的价值和风险: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,由于基金管理人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人及基金管理人实施过程中产生的积极管理风险、本基金的特有风险等。

本基金是一只股票指数增强型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时,本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。

投资者购买本基金或在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑投资者自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策,并仔细阅读(或申购)基金的投资目标、投资范围等投资作出独立决策。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,由投资者自行承担。

本基金的投资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对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(基金管理人或其高级管理人员、基金经理等人员)为发起资金提供方除外)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。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

本招募说明书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》施行之日起一年后开始执行。  
2020年6月1日起,对本招募说明书中的基金经理相关信息进行了更新。截至本招募说明书公告日,本基金无已披露的基金经理薪酬和价值表现数据。

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:中国证监会	
批准设立文号:中国证监会证监许可[2010]193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130000万元	
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	88.67	68.19%
大华资产管理有限公司	22.763	17.51%
三盈盈鸿投资有限公司	18.590	14.3%
合计	130,000	100%

基金管理人无任何受重大处罚记录。  
三、客服电话:400-800-4800(免长途话费)

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。曾任中国平安公司国际部干部,平安保险集团办公室主任,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总经理,平安人寿北京分公司总经理,平安基金副总经理兼基金管理部总经理,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RJMichals Inc.(美国)养老咨询分析师、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,新加坡证券有限公司执行董事,IDS唯高达咨询有限公司执行董事,平安证券有限责任公司副总经理,平安证券有限责任公司董事兼基金管理部/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委员兼主任。

杨宇晖女士,董事,学士,1983年生。曾任平安数据科技(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福利管理部高级人力资源经理,现任平安基金管理有限公司总经理。

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,现任大华银行集团董事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中国区,崇信托管(香港)投资有限公司董事,数码通电讯集团独立非执行董事,United Investments Private Ltd董事,United Oriental Capital G.P. Ltd董事,大华银行托管(香港)有限公司董事,United Pt. Equity Investments (Cayman) Ltd董事,新加坡大亚亚洲(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成员。历任新加坡政府投资公司“特别投资部”主管,负责投资,大华资产管理有限公司组合经理,国际股票和全球科技投资组合主管。

薛世贵先生,独立董事,硕士,1963年生。曾任江西省行政学院教师,深圳市龙岗投资集团有限公司投资部副部长,龙岗实业股份有限公司总经理,法定代表人,深圳市鑫德实业股份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,后加入广东万莱律师事务所任专职律师,兼任广东省律师协会理事、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,深圳职业技术学院教师,现任平安基金管理有限公司财务部高级会计主管,负责财务部项目助理,深圳职业技术学院经济系教师、会计专业主任,深圳职业技术学院会计处主任,现任深圳职业技术学院经济系副院长。

刘雪莹先生,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师,深圳华侨城集团会计部,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第二届“临时负责人”秘书,现任深圳市注册会计师协会副秘书长。

潘汉辉先生,独立董事,学士,1949年生。曾任招商局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行副总裁,现任彩星(香港)私人有限公司执行董事,合环环保控股有限公司独立董事,速建集团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  
巢敏文女士,监事长,硕士,1967年生。曾任江西客车厂科室助理工程师,深圳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,广东万莱银行主任,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及其旗下的富敦资产管理公司以及新加坡毕盛资产管理公司。鼎晟资本资产管理人。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会计主管,现任平安基金管理有限公司稽核稽核科。  
郭磊女士,监事,硕士,1979年生。曾任平安集团运营发展部助理,伏羲集团人力资源部经理,平安基金管理有限公司人力资源部副经理。

(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,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执行董事,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,大华银行集团行助理经理,电子渠道负责人,个人金融部投资产品销售主管,大华银行集团行助理,大华资产管理中国区大中华区业务开发

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,深圳分行信贷风险控制经理,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  
DANIEL DONGNING SUN先生,美国籍,北京大学硕士,美国哥伦比亚大学博士,约翰霍普金斯大学博士,先后担任瑞士再保险自营交易部量化分析师,花旗集团投资银行高级副经理,瑞士银行投资银行交易量化总监,德意志银行战略科技量化服务负责人。2014年10月加入平安基金管理有限公司,任衍生品投资中心投资执行助理,现任平安中证500指数增强型证券投资基金(2017-09-05至今)、平安沪深300指数量化增强证券投资基金(2017-12-26至今)、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金(2018-01-23至今)、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金(2018-03-07至今)、平安中证500指数增强型发起式证券投资基金(2020-05-27至今)基金经理。

毛时超先生,中山大学硕士研究生,2016年7月加入平安基金管理有限公司,曾任衍生品投资中心衍生品研究员、基金经理助理,现担任平安灵活配置混合型证券投资基金(2020-05-09至今)、平安中证500指数增强型证券投资基金(2020-05-09至今)、平安沪深300指数量化增强证券投资基金(2020-05-09至今)、平安中证500指数增强型发起式证券投资基金(2020-06-01至今)、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金(2020-06-01)至今)基金经理。

DANIEL DONGNING SUN先生,曾任管理基金的基金名称及管理时间:平安鑫荣混合型证券投资基金(2017-09-12至2018-11-12)。  
3.投资顾问委员会成员  
权益投资中心投资董事总经理李化松先生,权益投资中心投资副总张俊先生,研究中心研究执行总经理张路昊先生,固定收益投资中心投资执行总经理张文广先生,固定收益投资中心投资副总监周思远先生,固定收益投资中心基金基金经理王宏先生,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,权益投资中心基金经理黄维先生。

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.办理基金登记事宜;  
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.建立健全内部控制、监查与稽核、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《基金合同》、《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基金基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》及相关法律法规的规定,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.采取适当合理的措施(如基金合同)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、基金托管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簿、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内发出,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人处理时,应当对第三人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.基金管理人应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,将已募集资金并加计银行同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》的行为发生;  
2.基金管理人承诺不从事违反《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)不公平地对待管理的不同基金财产;  
(2)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;  
(3)向基金财产持有人违规承诺收益或者承担损失;  
(4)侵占、挪用基金财产;

(5)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;  
(6)玩忽职守,不按照相关规定履行职责;  
(7)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,强化业务操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,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他基金相关机构的合法权益;  
(4)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;

(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资料、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,利用对价、佣金等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

(11)歧视、排挤同行,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、欺成分;  
(13)以不正当手段谋求业务;

(14)有社会公共道德,损害证券投资基金从业人员形象;  
(15)其它法律、行政法规禁止的行为。  
4.基金管理人关于禁止性行为承诺  
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)从事法律、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时,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同意。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。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制,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变更后的规定执行。  
5.基金业绩承诺  
(1)依照有关法律法规和基金合同的约定,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、任何第三人谋取利益;  
(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资料、基金投资计划等信息;  
(4)不得从事内幕交易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完善、高效的内部控制制度。  
1.公司内部控制总体目标  
(1)保证公司经营管理活动的合法合规性;  
(2)保证基金运作有关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产: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流程中,并普遍适用于公司每一位员工;  
(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、各岗位职责分明,相互制衡;  
(4)独立性原则:内部控制机构应具有相对独立的机构、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:各种内部管理制度应具有高度的权威性,应当是所有员工严格遵守的行动指南;执行内部控制制度不能有例外,任何人不得有超越制度和违反授权的行为;严格执行内部控制制度不能有例外,任何人不得有超越制度和违反授权的行为。  
(6)及时性原则: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公司法律法规、政策制度等外部环境的变化及时相应的修改和完善;  
(7)成本效益原则:公司运用科学化的经营管理方法降低运营成本,提高经济效益,力争以合理的控制成本达到最佳的控制效果;

(8)防火墙原则:公司基本资产、自有资产、其他资产运作应当分离,基金投资研究、决策、执行、销售、估值等部门和岗位,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则;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范,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作办法,是对业务各个环节、流程进行的描述和约束。它们的内容相互衔接,层层深入,逐步细化,覆盖面逐层扩大,共同构成一个有机的制度体系,并随着法律法规和公司经营战略、政策制度的变化而及时修订、修订和增加,不断检讨、增补、修订和完善。

4.关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点  
(1)授权控制  
公司的授权控制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;各项经济业务和管理程序必须遵照管理层制定的操作规程,必须采取书面的授权书,授权书应当明确授权内容和范围。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,不受任何部门和个人的不当干预;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,研究人员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,并建立与所授权限相应的约束制度和考核标准。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机制,将重点投资限制在规定的风险限额内;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发出;应建立交易监控系统、预警系统和交易反馈系统,完善相关的安全设施;集中交易室应严格执行指令,建立公平的交易分配制度,确保各基金投资的公平;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)基金估值业务  
公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度,并根据复核控制建立严格的会计系统,对于不同基金、不同客户独立建账,独立核算;公司通过复验、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、编制、审核和发布工作,以此加强对信息的审查核对,使所公开的信息符合法律法规的规定,同时加强对信息披露的检查 and 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。根据公司章程监察稽核工作,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。  
公司设立合规管理部负责监察稽核工作,并保证法律合规监察稽核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,严格制订了专业间程序,操作程序和相关组织纪律。  
法律合规部强化内部检查制度,通过不定期或定期专项检查内部控制制度的执行情况,督促公司各项经营管理活动的规范运作。  
公司董事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,追究有关部门和个人的责任。

5.基金管理人关于内部控制制度的披露真实、准确;  
(2)基金管理人承诺将根据市场环境变化和公司业务不断发展完善内部控制制度。  
二、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  
注册日期:1983年10月31日  
注册资本:人民币2835.19亿元人民币  
法定代表人:刘肖君  
托管部“信息披露联系人:许建  
传真:(010)66594942  
中国银行客服电话:95566  
二、基金托管部及主要人员情况  
中国银行托管业务部成立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的投资、托管经验,部分人员曾留学或工作在海外,具有良好的外语、计算机专业技能,托管业务部是银行中资产规模较大、产品种类丰富的托管业务部门。在国内,中国银行已在全国、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、保险基金、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、受托理财服务,为各类客户提供了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2019年12月31日,中国银行已托管764只证券投资基金,其中境内基金722只,QDII基金42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,满足了不同风险偏好的投资者需求,本基金托管规模居同业前列。

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重要组成部分,秉承中国银行风险管理理念,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、风险控制和风险管理政策及制度建设、内外部检查及审计等措施构建托管业务全流程、全层面的风险管理制度,实现本业务条线全面风险管理目标,保障本业务条线合法合规运营。  
2007年起,中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得普华永道“SAS70”、AAFI“06”、“ISAE3402”和“ISAE16”等国际主流内控审阅机构无保留意见的内控审计报告。2017年,中国银行继续获得基于“ISAE3402”和“ISAE16”双标准的双项国际内控审计报告。2017年,中国银行托管业务部内控体系,内控措施完善,能够有效保证托管业务的正常、安全运行。

五、内部控制体系的建立和程序  
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出现投资指令违法、违反法律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、法规和基金合同约定的,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。  
三、基金托管人  
一、基金托管机构  
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:0755-22624881  
传真:0755-23990088  
联系人:郑权  
网址:www.fund.pingan.com  
2.其他销售机构  
详见基金份额发售公告或其他增加销售机构的公告。  
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:罗春风  
电话:0755-22624881  
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:上海市浦东新区浦东南路501号上海国金中心二期19楼  
负责人:俞卫锋  
电话:021-3135 8666  
传真:021-3135 8600  
经办律师:黎明、陈颀华  
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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
办公地址:上海市黄浦区四川路20号企业天地2号楼4楼普华永道中心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:郭素贞、邓昭君

联系人:邓昭君  
第四部分 基金的名称  
平安中证500指数增强型发起式证券投资基金  
第五部分 基金的类型  
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  
本基金为增强型股票指数基金,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,通过量化的方法进行积极的组合管理与严格的风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。力争使本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差率不超过7.75%。

二、投资范围  
本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股、备选成份股。其他国内依法发行上市的投资品种(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、衍生品工具(股指期货、国债期货、股票期权等)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债、政府支持债券、中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、资产支持票据、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、现金等,以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。  
本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务。

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为:本基金的股票资产占基金资产的比例不低于80%,投资于标的指数的成份股和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、国债期货和股票期权合约需缴纳的保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。  
如法律法规或监管机构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  
本基金为个股型指数产品,在参考标的指数成份股权重的基础上,根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整,力争在控制跟踪误差的前提下获取超越标的指数的投资收益。  
1.股票投资策略  
1)本基金将参考标的指数的成份股在指数中的权重比例构建投资组合,采取量化方法进行积极的股票选择与风险控制,在力求拟合、跟踪标的指数基础上,辅以量化的增强操作及一级市场股票投资,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。  
2)基于成份股基本面的分析增强  
鉴于中国股票市场的非完全有效性和指数跟踪本身的局限性及时效性,本基金将通过对标的指数成份股及其备选成份股的基本面分析,剔除、低配或超配部分标的成份股,以达到增强组合收益的效果。  
具体而言,主要考虑以下因素对成份股进行剔除或低配:  
①上市公司基本面状况差、缺乏或正在丧失核心竞争优势、盈利增长能力弱和持续性差等;  
②当前股价与中长期估值水平相比较在历史高位,或在可比公司中,股票相对估值水平偏高,并缺乏业绩支持;  
③其他重大风险,例如面临重大的不利行政处罚或司法诉讼的个股,有充分合理的理由认为市场价格被操作过热的个股。  
2)基于非成份股的投资增强  
本基金所跟踪的目标指数为中证500指数,本基金基于于中国证券市场个股和新股(含次公开发行和增发)深入研究的基础上,精选出具有综合性价比优势的个股,在基金投资比例允许的范围内适度参与非成份股和新股投资。  
①非成份股精选策略  
在控制风险水平和跟踪误差的前提下,为达成超越标的指数的收益的目的,在个股选择中运用多种因子策略精选股票进行投资。重点关注的多因子指标包括:估值类,从盈利、净资产、现金流、企业价值、留存收益、销售收入等角度衡量公司的估值水平。  
成长性,从盈利改善、经营效率、销售增长等角度衡量企业的成长速度。  
盈利质量类,从盈利能力、构成、财务质量、盈利利润率等衡量企业的盈利及运营水平。  
业绩波动,公司提前披露的盈利、收入预测类。  
分析师预期,从分析师的预期数据对公司盈利、销售收入等做预期变化。  
财务指标,从资产负债率、应收账款、存货、现金流、净资产等做预期变化。  
技术类,价值相关类因子等,包括市盈率、市净率、市销率、市价比等。  
高频类因子,日内成交的分布特征及分布特点。  
事件类事件,负面公告、负面舆情、处罚等。  
②一级市场股票策略  
在相关发行主体的基本面因素进行认真研究的基础上,结合二级市场的平均估值水平、类似事件上市之后的平均溢价率等指标,本基金将选择性地参与一级市场股票投资,或基本面向较好、股价被低估的增发或配股,以在不增加标的参与的前提下提高基金资产收益水平。  
本基金的投资目标为:力争使本基金的净值增长率与业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差率不超过7.75%。

四、债券投资策略  
本基金将以降低基金的跟踪误差为目的,在控制流动性的基础上,构建债券投资组合。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。基金管理人将优先选择信用等级高、剩余期限较短、流动性较好、溢价率较低的债券进行投资,合理分散基金资产在债券上的配置比例。  
3.股指期货投资策略  
本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目的,参与股指期货交易。投资原则为:基于基金资产增值,控制下跟踪误差实现保值和锁定收益。  
本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在证券市场总体行情的判断和综合风险因素分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济形势、政策及法规因素和资本市场因素,结合自研方法和量化工具,确定投资时机。基金管理人将结合投资组合的总体规模,以及中国证监会的相关规定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。  
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;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。  
基金管理人将在进行股指期货投资前建立衍生品投资决策部门或小组,负责股指期货投资的管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准执行。  
4.国债期货投资策略  
本基金参与国债期货的投资应符合基金合同规定的投资范围和与投资目标。本基金以套期保值为目的,根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,投资于国债期货合约,有效管理投资组合的系统性风险,积极调整组合,并充分借鉴国债期货。  
本基金通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断,并综合考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、谨慎进行投资,以调整投资组合久期,降低投资组合的整体风险。具体而言,本基金国债期货投资策略包括套期保值时选择策略、期货合约选择和寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。  
本基金在运用国债期货投资风险管理的基础上,将审慎地选择性的超额配置,通过国债期货对债券的多头替代和稳健资产仓位的变化,以及国债期货与债券的多空比例调整,获取组合的稳定收益。  
基金管理人针对国债期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程,确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作,并明确相关岗位职责。此外,基金管理人建立国债期货交易决策部门或小组,并授权相关管理人员负责国债期货的投资审批及实施,严格控制国债期货的投资比例。  
基金管理人将审慎开展国债期货业务,基金管理人将充分借鉴国债期货的有益经验,同时结合中国国情,在法律法规允许的范围内,通过创新等方式,基金还将积极探索其他投资品种,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。  
5.股票期权投资策略  
本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要的参与股指期货交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关规定和要求,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。  
若相关法律法规发生变化时,基金管理人股票期权投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规及监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,纳入投资范围并制定相应投资策略。  
6.资产支持证券投资策略  
基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素,预判资产池未来现金流变动。研究标的证券发行条款,预测提前还款率变化对标的证券平均久期和收益率曲线变化的影响,同时密切跟踪标的证券发行对标的证券收益的影响,在严格控制信用风险暴露的前提下,通过深入研究和动态调整,选择风险调整后收益较高的品种进行投资。  
7.融资及转融通证券出借业务投资策略  
本基金在参与融资融券、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则,在法律法规允许的范围内,控制出借比例,本着谨慎原则,参与融资和转融通证券出借业务。参与融资融券业务,本基金将力争利用融资融券的杠杆作用,降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时,本基金将在分析市场流动性、投资者类型与结构、基金历史申购赎回、出借证券流动性特征等因素的基础上合理确定出借证券的期限、期限和比例,力争为本基金份额持有人增厚投资收益。  
未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和优化相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。  
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)本基金的股票资产占基金资产的比例不低于80%,投资于标的指数的成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%;  
(2)每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。  
(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%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制;  
(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不得超过该证券的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制;  
(5)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;  
(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,不得超过该基金资产净值的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)