公允价值(元)

例(%)

平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书更新(摘要) [本基金不向个人投资者公开销售]

基金管理人:平安基金管理有限公司基金托管人:招商证券股份有限公司二零二零年三月

【重要提示】 1、本基金根据 2018 年 3 月 7 日中国证券监督管理系 瑞定期开放债券和证券 40 年

[重要提示]

1、本基金根据 2018 年 3 月 7 日中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于准予平安合瑞定期开放债券型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可12018]403 号)进行募集、本基金基金合同于 2018 年 3 月 26 日正式生效。
2. 基金管理人保证积款说明书的内容真实、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基允许,并对认购(或申购)基金的意愿,时机 数量等投资方价生因处立策。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. 本基金投资产证券市场、基金净值会因为证券市场成动等因素产生波动,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张度的系统性风险,对现现金等等。
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,交易不能放,指在收入市场流动性风险。当经债主体信用质量恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法要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

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都分、债券回购、银行存款(协议存款、通知存款(以及证期存款等其户银行存款)、同业存单、现金以及法律注照或中国证监会允许是金投资的其中固定收益法金融工具(但须符合中国证监会会的是会的程关现定。 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)、可交给选举

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。
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。
8.本基金初始募集面值为人民币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。
10.14年全管理人依照收尽职完,被付信用、透销勤勉的原则管理和示用基金财产。但不保证其全

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。

一定盈利,也不保证最低收益。
11、本基金单一投资者持有的基金份额可达到或者超过 50%,基金不向个人投资者公开销售。
本招募说明书所载内容截止日期为 2020 年 3 月 24 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。
本基金托管人招商证券股份有限公司于 2020 年 4 月 10 日对本招募说明书进行了复核。
第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

一、基金管理へ成00. 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:罗春风成分日期: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

联系电话:0755-22623179 2、股东名称、股权结构及持股比例:

才 基金管理人无任何重大行政处罚记录。 3.答服电话: 400-800-4800(免长途话费) 二.基金管理人主要人员情况 1.基金管理人主要人员情况 (1)董事会成员

(1)重事会成员 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。

14.30%

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年无荣阳平之虚使负管理有限公司执行董事。 转波先生,董事、硕士,1971年生。曾任 R.J.Michakki 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,Debitre Actuarial Consulting Ltd. (香港)精 類师,中国平安保险(集团)股份有限公司副总精理师。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自席财务官兼总精算师。 除敬达先生、董事、硕士,1981年生,新加坡。曾任香港罗兵成会计师事务所审计师;新鸿基证券 有限公司执行董事。IDSS 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总经理;平安证券有限责任公司副宣等人(制定整理;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总经理;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总经理;平安证券有限责任公司制度事长,中国平安保险(集团)执行委员 会执行师问,现任集团投资管理委员会副主任。 当字黟先生、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。 杨王萍女士、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,现任平安安保险(集团)股份有限公司人分资源中心。 "制度,每日为股份市报公司人分资源中心。"新规规则管理部高级人力资源经理。 中核诗即女士、董事、领士、1981年生,加拿大播。曾任职于强新银行"溢计银行、汇丰银行并担任高级管理职务。2011年加入大华银行集团强化后关军部高程、10年16年年,加全大场管理是公理兼看程区总裁兼大华银行任务员会设计等基本,数任明董事、大年银行任管(香港)有限公司董事、以任约《日本记录》,从"专工》,任于该不资产等理有限公司执行董事及首席执行 张文杰先生、董事、学士、1964年生,新加坡。现任大年资产管理有限公司执行董事及首席执行 任务不完生,当在第一次,1964年生,新加坡。现任大年资产管理有限公司执行董事及首席执行 任务不完生,有限公司总经理、法理科及司法等。是一位,1971年,是一位,1971年,是一位,1971年,是一位,1971年,是一位,1971年,是一位,1971年,

事务所高级合伙人、专联律师。 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

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部门临时负责人、秘书长助理、现任深训市注册会计师协会副部书长。 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、张任彩日本料理私人有限公司非执行董事、一台环保控股有限公司独立董事,建美建筑集团有限公司独立董事、企业集团有限公司独立董事。

(2)监事会成员 巢散文先生,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,广东南粤银行总行符核恋察部副经至理(主持工作)。总行人力资源部总经理 惠州分行等集功 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,

任.分行行长.总行稽核率总经理.現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,鼎厳资本管理公司。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副经理。 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监察稽核岗。 (3)公司高级管理人员

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。 参客从元生,同七、同级元的7mg-1760 十生。曾任中华至国志上云国岭阳十郎,于女际应秦却少公 室主任助理,平安人寿广州分公司副总参理,平安人寿危公司人事行及郡,任弟训郡会处理,平安越金管 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,学十,1970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,大华设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

3.仅以代來與內云以口 固定收益投資中心投资执行总经理张文平先生,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

心工。 上述人员之间不存在近亲属关系。

二、金亚自建入的40页 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、

1、IKCG分本以上,1/18公分本 原口和登记字官: 2.办理基金备案手续; 3.目(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 %// 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继定的"通常学简格"的"智慧及父母首是学的说。"陈亚的首星也多强加多亚州 一基金管理人的财产相互继定、对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行正券投资; 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、不得委托第二人运作基金财产

取利益。不得委托第三人运印整定则广; 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 4. 建介基金会计核算并编制基金财务会计报告; 10. 编制季度报告,申期报告和年度报告; 11. 严格按照(基金法)《基金合同)及其他有关规定。履行信息按露及报告义务;

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《基金合同的沙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;

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

天贞村的复印片; 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、其赔偿责任不因其践任而免除; 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 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,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日內退还基金认

; 25、执行生效的基金份额持有人大会的决议;

26.建立法保存基金份额持有人公司 26.建立法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 3.塞金管理人的寿始 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 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 70年下7月7月7日及至: (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;

(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

(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;

(7)邓忠耿守,不按照规定履行职页; (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)放章根市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、服挠或严重影响中国证监会依法监管; (6)远忽职守,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

· 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)眨周同行,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)以不正当手段读求业务发展;
(14)有撑社会公德,损害证券投资基金人员形象;
(14)有撑社会公德,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;

(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)违反规定问他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其地基金份额,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、行政法规则或监管部门取消或变更上达禁止性规定,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。
基金管理人运用资格。
基金投资则不再受相关限制或按变更后的规定执行。
基金管理人营业数量的投资目标的设置,或者从事其他重大关联交易的,应进行者基金股资则不再受相关限制或按变更后的规定执行。
基金管理人运用差金财产买卖基金管理人,基金指管人及其控股股东,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,通槽基金份额符有人和益保产的原则。防产制益中突,建立避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。重大关联交易应避免基金管理人董事会证该,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)依据有关键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

(2)不协助,接受委托或以其他任何形式为其他组织现工入还11世分太少,17万里水分之之之。 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)不以申損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 场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、高效的内部控制依据。

制体系。 1、公司内部控制的总体目标 1、公司内部控制的总体目标

1.公司內爾控制的总体目标 (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.公司內那控制遵循的原则 (1)全面性原则:內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

宣必须权贡分明; (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

(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、能有任何例外、任何人不得拥有超越制度或进度处理命的权力、(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。

行 清算、评估等部厂和岗位,应当在物理上和制度上适当隔离。
3.内部控制的制度体系
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、定是公司制定各项规章制度的纲要
和总规、第一个层面是公司基本管理制度。包括区处管制制度,投资管理制度,基金会计制制度(息息按
露制度、监察辖核制度(自息技术管理制度)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、置。一个层面是和图),以为企业分别使为企业分别使为企业分别的企业分别,该位分位置,该位责任、操作于则等的具体说明,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、流程进行的描述和的束。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常。公司重视对制度的持续体验。结查业务的
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

4、天士夜秋、研究、投資、交易寺力围的经制点 (1)複效制度 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 设建公司逐级授权制度,确保公司各项规定制度的贯彻执行;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

(2)公司研究业。 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;建立投资产品各选库制度,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各选年。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 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;在进行投资时应有时确的投资投权制度,并应建立与所投权限相应的约束制度不是进行发生产 产作在进行投资时应有时确的投资投权制度,并应建立与所投权限相应的约束制度不为核制度。 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)父初业分 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 处理会立其是转变的人生。 (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。

(7)监察稽核 血系目域 接近曾餐长, 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 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 、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

进行审议。 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 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。 公司以及在年日观显示形式。 明确了法律合规监察都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。 法律合规监察都强化内部检查制度,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, 公可重与云州自建宏元为 是及中人的最高的自己的。 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 第二部分 基金托管人 完善内部控制制度

(一)基金托管人情况 1.基金托管人基本情况 名称:招商证券股份有限公司 住所:深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 法定代表人:霍达 成立时间:1993年8月1日 组织形式:股份有限公司 主册资本:66.99 亿元

基金托管资格批文及文号:证监许可[2014]78号 联系人:韩鑫普 联系电话:0755-26951111 报商证券是百年招商局旗下金融企业、经过二十多年创业发展、已成为拥有证券市场业务全牌的一流券商,并经中国证券监督管理委员会评定为A类AA级券商。招商证券具有稳定的持续盈能力,科学合理的风险管理架构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务集道,在北京上海、州、深圳等城市拥有249家批准设立的证券营业都和12家证券经纪业务管理分公司,同时在香港 厂州、涤测等城市拥有 249 家批准设立的证券营业部和 12 家业券经纪业务管理分公司,同时任备港 设有分支机构、全资拥有招商证券国际有限公司,招商则货有限公司、招商政选资本投资有限公司、 招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司,参股博时基金管理公司、招商基金管理公司、 广东股权交易中心股份有限公司及证通股份有限公司、构建起国内国际业务一体化的综合证券服务 平台。招简证券数力于"企调提升核心竞争力,打造中国最佳投资银行"。公司将以建越的金融股务实 现客户价值增长,推动证券行业进步,立志打造产品丰富。服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金

融机构,成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业 2、主安人员情况 招商证券托管部员工多人拥有证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验,以及大型 IT公司的软件设计与开发经验,人员专业背景覆盖了金融,会计、经济、计算机等各领域,其中本科以上人员占比100%,高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。

3、基金托管业务经宫情况 招商证券是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司,可为各类公开募集资金设立的证 券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施、稳定、高效的托管业务系统;完善的业务管理制度。招简证券托管都本者"诚实信用"谨慎勤勉"的原则,为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外,招商证券于2012年10月获得了证监金推任开展私募基金综合托管服务认证 正式批复,成为业内首家可从事私募托管业务的券商,经验丰富,服务优质,业绩突出。截至 2019 年 四季度,招商证券共托管 36 只公募基金。)基金托管人的内部控制制度

内即区制口你 商证券作为基金托管人 (1)托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作 的经营思想和经营理念 (2)建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系,保持托管业务内部控制制度健全、执行

。 (3)防范和化解经营风险,提高经营管理效益,使托管业务稳健运行和受托资产安全完整,实现 (4)不断改进和完善内控机制、体制和各项业务制度、流程,提高业务运作效率和效果。

公內即於即班班哲科 招商证券股份有限公司经营管理层面设立了风险管理委员会。作为公司内部最高风险决策机 构、风险管理委员会负责审议公司风险管理政策、风险偏好、容忍度和经济资本等风险限额配置方案,拥有公司重大风险业务和创新业务项目的最终裁量权。风险管理部、法律合规部及稽核部为公司 心直達称能即]。 托管部内部设置专门负责稽核工作的内控稽核岗,配备专职稽核人员,依照有关法律规章,对业

托管部内部设置专门负责褶核工作的内控情核网,配育专职信核人风,取照有大压于水平,0,3上条的运行独立行使监督稽核职权。 3、内部控制制度及措施 招商证券托管部制定了各项管理制度和操作规程,建立了科学合理,控制严密,运行高效的内部 控制体系,保持托管业务健全,有效执行;安全保管基金财产,保持基金财产的独立性;实行经营场所 封闭式管理,并配备录音和录像监查系统,有独立的综合托管服务系统;业务管理实行复核和检查机 制,建立了严格有效的操作制约体系,托管部树立内控优先和风险管理的理念,培养部门全体员工的

(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

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定、对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督、并及时提示基金管理人违规

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和托管协议的规 它。应及时以电话提幅或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式分基金托管人的监督和核查。基金管写的解义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限 为及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正 基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的, 第三部分 相关服务机构 正的,基金托管人应报告中国证监会

一、基金份额销售机构 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:0755-2262762 传真:0755-23990088 联系人:郑权

平安基金管理有限公司 专真:0755-23990088 、律师事务所和经办律师 名称:上海市通力律师事务所

网址: www.fund.pingan.com

经办律师:黎明、陈颖华

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 联系人:陈颖华 电话:021-31358666

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, 上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号普华永道中心 11 楼 法定代表人; 李丹 传真电话:(021)2323 8800 传真电话:(021)2323 8800 经办注册会计师:曹翠丽、邓昭君 联系人:邓昭君

第四部分 基金的名称 平安合瑞定期开放债券型发起式证 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 契约型开放式

第七部分 基金的投资 求及行动。 本基金在严格控制风险及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

二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、地方政府债 金融债、次级债、央行票据、企业债、中小企业私募债、公司债、中期票据、短期融资券。超短期融资券。 债券回购、资产支持证券、可分离交易可转债的独债部分、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期 存款及其他银行存款、同业存单、现金等货币市场工具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)。

其他金融上具(担项符合中国址监会的相关规定)。 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。 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,基金投资不受上途比例限制;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。

一.投資策略 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公期配置策略、美属资产配置策略、今券选择策略。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。 挂招限和珍等政公

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

封闭期投资策略1、资产配置策略

1.50. ELEUWH 本基金投资组合中债券。现金各自的长期均衡比重,依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基 定位为债券型基金,其资产配置以债券为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件 、本基金将综合考虑宏观形策。市场信值水平、风险水平以及市场情绪,在一定的范围内对资产配 调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。 (1)组合久期配置策略

通过预测收益单级的形状和变化趋势,对各类型债券进行久期配置;当收益率曲线走势难以 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 綜收益率曲线的跨乘策略和越于收益率曲线变化的子频等略 紅鈴鄉及榜式縣略及榜代 蘇收益率曲线的跨乘策略和越于收益率曲线变化的子频策略 紅鈴鄉的及跨域路 组合的各种风险在控制范围之内。 (2)类属资产配置策略

(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、利差变对情况。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和等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,在目标入期管理的基础上,运用修正的均值一方差等模型,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。

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局气度特性的研判,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。 (1)自类等88

本基金将通过正回购,融资买人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人品种,灵活控制杠杆组合仓位,降低组合波动

本部分策略强调公司价值挖掘的重要性,在行业周期特征、公司基本面风险特征基础上制定绝对收益率目标策略,甄别具有估值优势,基本面改善的公司,采取高度分散策略,重点布局优势债券,

1/1信用顶投资取除 在信用惯的选择方面,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,并结合积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,通过对信用和差的分析和管理,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 差成动情况,积极寻找跨市场中现券和回购操作的套利机会。

差波页消存化。於极于12岁日29世29大平129年17104五年17104五年 2)中小企业私募债券投资策略 村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,为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 页案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险

预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等合件内心心。 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。

四、投资限制 1、组合限制 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%。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制;其中,现金不包括结算备付金、存出保证

资产净值的 5%。在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制;其中,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同同业市场市场进行债券回购的资金金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

《9/平盛本日地八日地印土印地西地达以 17 《76日》 《英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 (11)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%,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

广学值即140%; (13)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该基金资产争值的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 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) 本基金与私募全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、可接受原押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持。实 (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比例不符合上法规定投资比例的、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 分定。在上述期间内、基金的投资范围、投资策略应当存占基金合同的分定。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。

は東京 10 日本 10 日本

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;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(4) 近天晚起中间的人比較级時間應時上所。 (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 基金曾堪人应用基金财产头卖基金曾埋入、基金社曾人及其形股股东、实际挖制人或者与其有 其他重大利害关系的公司货行的证券或者车销期内实销的证券。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额路,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 内那审批机期和评估机制、按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到选金托管人的同意。 并按注律法规于以披露。重大关联交易远想交选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、行政法规或监管衙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 五、业筑比较基准 本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率 中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的 跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债。金融债券及企业债券组成, 正指数有限公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标、为债券投资人提供 资分析工具和业绩评价基准。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

作为本基金的业绩比较基准。 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根中国证监会备案后,适当调整业绩比较基准 并及时公告,而死需召开基金份额特有人大会。

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

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。

以及555日 16日 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 对其内容的哀实性。推确性和完整性系推个别及正常责任。 基金托管人招商证券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 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 1,500,361,500.0 97.97 其中:债券 1.487.361.500.00 97.12 资产支持证券 13,000,000.00 0.85 5 金融衍生品投资 6 买人返售金融资 其中:买断式回购的买入返售 7 银行存款和结算备付金合计

22,879,542,1

100.00

1.531.489.654.46

1,531,489,654,46

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
本基金本报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本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	693,530,500.00	64.48	
	其中:政策性金融债	208,559,500.00	19.39	
4	企业债券	311,798,000.00	28.99	
5	企业短期融资券	-	=	
6	中期票据	413,104,000.00	38.41	
7	可转债(可交换债)	-	=	
8	同业存单	68,929,000.00	6.41	
9	其他	-	=	
10	合计	1,487,361,500.00	138.29	

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	1920047	19 宁波银行小 微债 01	700,000	70,525,000.00	6.56				
2	1820039	18 南京银行 02	500,000	51,945,000.00	4.83				
3	180203	18 国开 03	500,000	51,145,000.00	4.76				
4	180304	18 进出 04	500,000	51,065,000.00	4.75				
5	180208	18 国开 08	500,000	50,900,000.00	4.73				
1.6	报告期末按公允	价值占基金资产	净值比例大小技	非序的前十名资产支持	证券投资明细				

18 建花 A 1.7 报告期末按公允价值占基金资产产本基金本报告期末未持有贵金属投资

证券名称

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

19.2 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工国债期货投资。 19.3 本期国债期货投资。 19.3 本期国债期货投资。

1.10 投资组合报告附注

1101 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

本基金本报告期末未持有股票。

证券代码

1.10.3 其他资产构成 1 存出保证金 79,973.03 2 应收证券清算款 应收股利 2,799,569.15 应收利息 5 应收申购款 7 待摊费用

22,879,542.18

第八額分 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行到阅读太基金的招募说明书。——自基金转型以来(2018年3月26日)至2019年12月31日基金份额净值增长率及其与同期业级批较基准收益率的比较。

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	1)-3)	2-4
5.48%	0.06%	6.73%	0.08%	-1.25%	-0.02%
4.69%	0.04%	4.96%	0.05%	-0.27%	-0.01%
10.43%	0.05%	12.02%	0.07%	-1.59%	-0.02%
	份额净值 增长率① 5.48% 4.69%	份额净值 增长率① 增长率标 准差② 5.48% 0.06% 4.69% 0.04%	份额争值 份额争值 业绩比较 增长率标 基准收益 准差② 率3 5.48% 0.06% 6.73% 4.69% 0.04% 4.96%	け額等値 対条等値 並続比较 並続比较 増长率の 推差② 率3 ま作以益 率标准差 4.69% 0.06% 6.73% 0.08% 4.69% 0.04% 4.96% 0.05%	分額争值 增长率① 增长率标 建准② 率标准差 准差② 率③ 0.06% 6.73% 0.08% −1.25% 4.69% 0.04% 4.96% 0.05% −0.27%

现比较整件: 下加至10月80岁至于,自基金合同转型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

平安合瑞定开债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 9.62% 8.41% 7.21% 5.01% 4.81% 3.61% 2.40% 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0.26 | 0.0

注:1、本基金基金合同于2018年3月26日正式生效,截至报告期已满一年; 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。建仓结束时各项资产配置比例符合基金合同的约定。

第九部分 基金费用与税收

第九部分 基金费用与税收

- 基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;

2.基金社管人的托管费;

3.《基金合同》上效后与基金相关的信息披露费用;

4.《基金合同》上效后与基金相关的信息披露费用;

4.《基金合同》上效后与基金相关的会计师费、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.基金的银行汇划费用;

8.基金的银户开户费用、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

基金管用价管理费

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。管理费的计算方法按

二、基金實用八的管理费 本基金的管理费特的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=Ex 0.30%-当年天教 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的 0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=Ex 0.30%-当年天教 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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费均付指令,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 人名迪法定节假日 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=Ex 0.10%-当年天教 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 基金托管费的计算,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到付指令。经基金托管费到付指令。经基金托管费到付指令。经基金托管费到付指令。经基金托管费到付指令。经基金托管费到付指令。经基金托管费到付指令。经基金托管费到付指令。经基金托管费到付指令。经基金托管费到人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遗法定节假日、公休假或不可抗力等,支付日期顺延。上述"一、基金管用的种类"中第 3-9 观费用 根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出逾额列入当期费用。由基金长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、基金费用的项目下列费用不列、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

、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

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。 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)2019年3月26日至2020年3月24日发布的公告:

2019年3月27日 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金2018年年度报告以及摘要 关于平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业 8的公告 2019年4月9日 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告 安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书更新(2019年第1 2019年5月9日 P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

2019年6月18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6月30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 安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年第 2 季度报告 2019年7月16日 于平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业 2019年7月19日 2019年8月8日 于平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告 2019年8月20日 安基金管理有限公司高级管理人员变更公 安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告(摘要) 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告 关于平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业 2019年10月23日 2019年10月24日 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金2019年第3季度报告 安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金分红公 于旗下 12 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 安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议 2019年12月27日 2019年12月27日 P安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书更新摘要 2019年12月27日 P安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书更新 2019年12月27日 安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年第 4 季度 于平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换。 2020年1月23日 关于平安基金管理有限公司旗下部分基金调整开放申购、赎回及转换业务力 2020年1月30日

(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 第十部分,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》等有关法律法规的要求及基金合同的规定,对 2019 年 1月 27 日公布的《平安台瑞定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书更新》进行了 更新,主要更新的内容如下:

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

P安基金管理有限公司高级管理人员变更公

所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"重要提示"部分。
3.根据最新资料,更新了"第三部分、基金往管人"。
3.根据最新资料,更新了"第四部分、基金的性管人"。
5.根据最新资料,更新了"第五部分、基金的投资"。
6.根据最新资料,更新了"第十部分、基金的投资"。
7.根据最新资料,更新了"第十十部分、基金的建筑"。
8.根据最新情况,更新了"第二十二部分、其他应披露事项"。
8.根据最新情况,更新了"第二十二部分、对招募说明书更新部分的说明。"

平安基金管理有限公司