平安大华策略先锋混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2012年第1期

基金管理人：平安大华基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

【重要提示】

平安大华策略先锋混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2012年2月27日经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】248号文核准募集。本基金基金合同于2012年5月29日正式生效。

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》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

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，请认真阅读基金合同、本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，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。投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，投资本基金可能遇到的风险包括：政府政策变化等因素带来的行业风险以及行业股票整体表现可能较差的风险，基金投资回报可能低于业绩比较基准的风险，证券市场整体环境引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，大量赎回或暴跌导致的流动性风险，基金投资过程中产生的操作风险，因交收违约和投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险，等等。本基金为混合型基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。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引致的投资风险，由投资者自行负责。

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并不构成对本基金业绩表现的保证。

本招募说明书（2012年第1期）所载内容截止日期为2012年11月29日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为2012年9月30日。有关财务数据未经审计。

本基金托管人中国银行股份有限公司于2012年12月21日对本招募说明书（2012年第1期）进行了复核。

一、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1、基金管理人：平安大华基金管理有限公司
注册地址：深圳市福田区大中华国际交易广场第八层
办公地址：深圳市福田区大中华国际交易广场第八层
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：杨秀丽
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30000万元
存续期间：持续经营
联系人：支璇
联系电话：0755-22625535

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	18,210	60.7%
新加坡大华资产管理有限公司	7,500	25%
三亚盈湾旅业有限公司	4,290	14.3%
合计	30,000	100%

基金管理人无任何受处罚记录。

（二）主要人员情况

1、董事、监事及高级管理人员

（1）董事会成员

杨秀丽女士，董事长，硕士，高级经济师。曾任平安保险公司办公室主任；平安保险公司办公室、董事会秘书处主任、秘书长；平安保险公司总经理室总经理助理、副总经理；平安证券有限责任公司董事长兼总经理；中国平安保险（集团）股份有限公司副总经理。

李克难先生，董事，博士，1960年生。曾任湖南大学教师；湖南省政府经济研究信息中心经济预测处副处长、副研究员；湖南省政府研究室宏观经济处正处级研究员；湖南省委省政府经济发展战略研究小组成员；湖财证券公司副总裁兼研发中心总经理、副总裁兼北京管理总部总经理；湖财荷银基金管理公司总经理；信达澳银基金管理公司总经理。

陈敏达先生，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。

王世荣先生，董事，学士，1950年生，新加坡。曾任大华银行有限公司金融机构（银行）部业务高级经理；新加坡贴现公司（大华银行的子公司）总经理；大华银行有限公司政府证券及债券部第一副总裁；大华银行有限公司黄金及期货部和外汇资金服务部高级副总裁；大华银行有限公司国际银行业务执行副总裁；大华银行有限公司环球金融与投资管理业务高级执行副总裁。

姚波先生，董事，硕士，1971年生。现任平安保险（集团）股份有限公司总经理助理、总精算师兼企划精算部总经理。历任R.J.Michalski Inc（美国）、Guardian Life Inc.co（美国）、Swiss Re（美国）精算师助理、精算师，平安保险（集团）股份有限公司副总精算师、副总经理、财务副总监、企划精算部总经理、总经理助理、总精算师兼企划精算部总经理等职务。

高鹏先生，董事，学士，1977年生。曾任新疆伊犁人民广播电台节目部副主任、平安人寿保险公司新疆分公司总经理秘书、营业区主管、中心支公司负责人、营销管理部主管、中国平安保险（集团）股份有限公司科室主任、员工服务部/人才储效管理部/新酬规划管理部副总经理（主持工作）。

张文杰先生，董事，学士，1964年生。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，国际投顾和全球科技团队主管。

曹勇先生，独立董事，博士，1954年生，新加坡。曾任中国社会科学院经济研究所发展研究室副主任；澳大利亚工业研究院研究员；新加坡南洋理工大学、南洋理工学院讲师，南洋理工学院、亚洲商业与经济研究中心、中国经济研究部研究主任；南洋理工大学，南洋商学院，管理经济学硕士项目副主任；南洋理工大学，亚洲商业与经济研究中心主任；南洋理工大学，南洋商学院副院长；南洋理工大学，南洋商学院副教授。现任南京大学特聘教授；瑞丰生物科技（新加坡上市企业）独立董事。

刘茂山先生，独立董事，学士，1935年生。曾任中央人民政府林业部干部学校干部；中央林业部人事司干部；南开大学经济学系政经教研室主任兼支部书记；南开大学金融学系副主任、主任；南开大学风险管理与保险学系系主任；中国平安保险集团博士后工作站指导专家。

郑学定先生，独立董事，硕士，1963年生。曾任江西财经大学会计系教师；深圳市财政局会计处公务员；深圳市注册会计师协会秘书长；深圳天健信德会计师事务所合伙人。

黄士林先生，独立董事，学士，1954年生。现任广东圣天平律师事务所主任律师，中国人民大学律师学院副理事长，兼职教授。历任国家劳动人事部政策研究室法规处副处长，深圳法学研究发展中心主任。

（2）监事会成员

叶素兰女士，监事会主席，学士，香港。曾任纽约计算机开发公司电脑顾问；香港快速系统服务公司高级系统分析师；美国国际数据公司（AIA）管理信息系统助理总监；澳大利亚Westpac银行项目经理；美国国际数据公司（AIA）管理信息系统助理总监；香港Jardine CMG有限公司高级主管；香港保诚保险公司IT主管；友邦保险（AIA）运营、IT总监；中国平安人寿保险股份有限公司总经理助理兼运营中心总经理。现任中国平安保险（集团）股份有限公司公司总经理助理兼首席稽核执行官；平安大华基金管理有限公司监事会主席。

林炯伟先生，监事，学士，1964年生，新加坡。曾任三井银行交易员、华联银行资金部IT负责人、大华银行全球资金-营运与IT部门，副总裁兼主管、大华黄金与期货公司董事、大华资产管理有限公司高级总监、大华银行第一副总裁，现任大华资产管理有限公司执行董事、首席运营官。

滕大江先生，监事，学士，1972年生。曾任广深铁路电务有限公司研发工程师；平安证券公司八卦三路营业部电脑部经理；平安证券风险管理部风险监控室；平安证券风险管理部风险评估室；平安大华基金公司监察稽核部IT财务稽核岗。现任前海开源基金管理有限公司（筹）监察稽核部负责人。

（3）公司高管

李克难先生，总经理，博士，1960年生。曾任湖南大学教师；湖南省政府经济研究信息中心经济预测处副处长、副研究员；湖南省政府研究室宏观经济处正处级研究员；湖南省委省政府经济发展战略研究小组成员；湖财证券公司副总裁兼研发中心总经理、副总裁兼北京管理总部总经理；湖财荷银基金管理公司总经理；信达澳银基金管理公司总经理。现任平安大华基金管理有限公司总经理。

毕亮亮先生，副总经理，硕士，高级经济师，1966年生。曾任平安保险集团办公室总经理助理、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。现任平安大华基金管理有限公司副总经理。

林婉文女士，副总经理，学士，新加坡。曾任新加坡大华银行集团内部顾问，电子渠道负责人，投资服务部门产品销售主管，大华资产管理公司大中华区业务开发主管，高级董事。现任平安大华基金管理有限公司副总经理。

（4）督察长

肖宇鹏先生，督察长，学士，1970年生。曾任中国证监会江西证监局主任科员及中国证监会上海专员办证券公司风险处置一处副处长。现任平安大华基金管理有限公司督察长。

2、基金经理

颜正华先生，复旦大学经济学硕士，上海交通大学工学学士。曾任国海证券证券投资部投资策划部经理，江南证券研究所策略研究中心经理，深圳中兴通讯股份有限公司产品事业部信息策划组组长。曾任华夏基金管理有限公司股票投资部策略分析师，基金经理助理，华夏回报证券投资基金、华夏回报二号证券投资基金基金经理。现任平安大华基金管理有限公司投资研究部总经理，兼任平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金经理。

孙健先生，基金经理，硕士，1975年生。曾任湘财证券有限责任公司资产管理总部投资经理，中国太平人寿保险有限公司投资部、太平资产管理有限公司组合投资经理，摩根士丹利华鑫货币市场基金基金经理，银华货币市场证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金基金经理。现任平安大华保本混合型证券投资基金基金经理、平安大华添利债券型证券投资基金基金经理。

焦巍先生，基金经理，博士，1973年生。曾任中国银行海南分行科员，湘财证券海口营业部咨询师，湘财合丰基金管理公司研究部银行及房地产行业研究员，汉唐证券资金管理中心首席交易员。现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理、平安大华行业先锋股票证券投资基金基金经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

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
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人：肖钢
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
托管及投资者服务部总经理：李爱华
托管部门信息披露联系人：唐卅徽
电话：（010）66594855
传真：（010）66594942

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，现有员工120余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展赫兹评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2011年末，中国银行各类托管资产规模突破两万亿元，居同业前列。

（三）证券投资类基金托管情况

截至2012年6月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景安封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选或兴混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时主题债券型、易方达发丰债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同福信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信智智中证500指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板300成长交易型开放式指数、国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深300交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融50指数债券型、180等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业大盘精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）、海富通大中华精选股票型（QDII）、招商标普金融四国指数（LOF-QDII）、华宝兴业成熟市场动量优选（QDII）、大成标普500等权重指数（QDII）、长信标普100等权重指数（QDII）、博时抗通胀增强回报（QDII）、华安大中华升级股票型（QDII）、信诚全球商品主题（QDII）、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型（QDII）、易方达标普全球高端消费品指数增强型、建信全球资源股票型等164只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自1998年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当担他执行，立即通知基金管理人，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、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构
平安大华基金管理有限公司
办公地址：深圳市福田区大中华国际交易广场第八层
法定代表人：杨秀丽
电话：0755-22627627
传真：0755-23990088
联系人：叶俊林
网址：www.fund.pingan.com

2、代销机构
（1）中国银行股份有限公司
注册地址：北京市复兴门内大街1号
办公地址：北京市复兴门内大街1号
法定代表人：肖钢
联系人：马学彬
联系电话：010-66594552
客服电话：95566
传真：010-66594465
网址：www.boc.cn
（2）中国农业银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：蒋超良
客服电话：95599
传真：010-85109219
网址：www.abchina.com
（3）中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
联系人：王琳
联系电话：010-66275654
客服电话：95533
传真：010-66275654
网址：www.ccb.com
（4）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
联系人：曹榕
联系电话：021-58781234
客服电话：95559
传真：021-58408483
网址：www.bankcomm.com
（5）平安银行股份有限公司
注册地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
办公地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：孙建一
联系人：张菁
联系电话：0755- 22166118
客服电话：95511/95501
传真：0755-82080406
网址： www.pingan.com.cn
（6）温州银行股份有限公司
注册地址：温州市车站大道196号
办公地址：温州市车站大道196号
法定代表人：邢增福
联系人：林波
联系电话：0577-88990089
客服电话：96699（浙江省）962699（上海）0577-96699（其它地区）
传真：0577-88990169
网址：www.wzcb.com.cn
（7）宁波银行股份有限公司
注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号
办公地址：宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人：陆华裕
联系人：胡技勤
联系电话：0574-89068340
客服电话：上海962528其他地区96528
传真：0574- 89068221
网址：www.nbcb.com.cn
（8）申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海常熟路171号
办公地址：上海常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系人：曹晖
联系电话：021-54033888
客服电话：95523或4008895523
传真：021-54038844
网址：www.sywg.com
（9）齐鲁证券有限公司
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：王薇
联系电话：0531-68889157
客服电话：95538
传真：0531-68889752
网址：www.qlzq.com.cn
（10）国海证券股份有限公司
注册地址：广西桂林市辅星路13号
办公地址：广东省深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3层
法定代表人：张雅锋
联系人：牛孟宇
联系电话：0755-83709350
客服电话：95563
传真：0755-83704850
网址：www.ghzq.com.cn
（11）方正证券股份有限公司
注册地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：郭军瑞
联系电话：0731- 85832503
客服电话：95571
传真：0731-85832214
网址：www.foundersc.com
（12）湘财证券有限责任公司
注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人：林俊波
联系人：钟康莹
联系电话：021-68634510
客服电话：400-888-1551 .95532
传真：021-68865680
网址：www.xcsc.com
（13）中国中投证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人：龙增来
联系人：刘毅
客服电话：400-600-8008
传真：0755-82026539
网址：www.cjis.cn
（14）平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
联系电话：0755-22626319
客服电话：400-8816-168
传真：0755-82400862
网址：www.pingan.com
（15）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
联系人：吴倩
联系电话：021-38676666
客服电话：400-8888-666
传真：021-38670666
网址：www.gtja.com
（16）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：胡运钊
联系人：李良
联系电话：027-65799999
客服电话：95579或4008-888-999
传真：027-85481900
网址：www.95579.com
（17）浙商证券有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6/7 楼
办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6/7 楼
法定代表人：吴承根
联系人：许喜子
联系电话：0571-87901912
客户电话：967777
传真：0571-87902090
网址：www.stocke.com.cn
（18）中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
联系电话：010-60838888
传真：010-60833739
网址：www.cs.ecitic.com
（27）中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区香岭路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：张智河
联系人：吴忠超
联系电话：0532-85022326
客服电话：0532-96577
传真：0532-85022605
网址：www.zxwt.com.cn
（28）中信证券（浙江）有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：沈强
联系人：丁思聪
客服电话：0571-96598
传真：0571-86065161
网址：www.bigsun.com.cn
（29）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号国际企业大厦C座
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：顾伟国
联系人：田薇
客服电话：400-8888-888
传真：010-66568990
网址：www.chinastock.com.cn
（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
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
电话：0755-82558305
客服电话：400-800-1001
传真：0755-82558355
网址：www.essence.com.cn
（31）东海证券有限责任公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人：朱科敏
客服电话：400-8888-588
传真：0519-88157761
网址：www.longone.com.cn
（32）中航证券有限公司
注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：杜航
联系人：戴蕾
联系电话：0791-86768681
客服电话：400-8866-567
传真：0791-86770178
网址：www.avicsec.com
（33）长城证券有限责任公司
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：黄耀华
联系人：李春芳
联系电话：0755-83516089
客服电话：400-6666-888
传真：0755-83515567
网址：www.cgws.com
（34）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：高冠江
联系人：唐静
联系电话：010-63081000
客服电话：400-800-8899
传真：010-63080978
网址：www.cindasc.com
（35）东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：吴宇
联系电话：021-63325888
客服电话：95503
传真：021-63326173
网址：www.dfzq.com.cn
（36）日信证券有限责任公司
注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址：北京市西城区阜市口大街1号长安兴融中心西楼11层
法定代表人：孔佑杰
联系人：文思婷
联系电话：010-83991737
客服电话：4006609839
传真：010-66412537
网址：www.rxzq.com.cn

（二）基金注册登记机构

平安大华基金管理有限公司
注册地址：深圳市福田区大中华国际交易广场第八层
办公地址：深圳市福田区大中华国际交易广场第八层
法定代表人：杨秀丽
电话：0755-22624581
传真：0755- 23998639
联系人：张平

（三）律师事务所和经办律师

律师事务所：北京市京伦律师事务所
地址：北京市海淀区中关村南大街17号韦伯时代中心C座1910
负责人：曹斌（执业证号：11101200110651368）
电话：010-68938188
传真：010-88578761
经办律师：杨晓勇（执业证号：11101200210185600）
王月贤（执业证号：11101201011310452）
联系人：杨晓勇（执业证号：11101200210185600）

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
法定代表人：Ng Albert Kong Ping 吴港平
联系电话：010-58153000
传真电话：010-85188298
经办注册会计师：吴翠容、周刚
联系人：林安睿

四、基金的名称

平安大华策略先锋混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资

（一）投资目标

通过积极进行资产配置和灵活运用多种投资策略，在有效控制风险的前提下，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，谋求基金资产的持续、稳健增值。

（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股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规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。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为30%-80%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为20%-70%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的3%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

（三）投资理念

通过对股票市场和债券市场投资趋势的定量和定性分析，进行积极的资产配置，能有效控制投资风险实现更高回报。同时，多种投资策略的灵活运用，能够充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，创造投资组合超额收益。

（四）投资策略

1、资产配置策略

本基金基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析，结合经济周期理论，形成对不同市场周期的预测和判断，进行积极、灵活的资产配置，确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。

本基金通过平安大华大类资产配置评价体系（TAES）（PINGAN-UOB TACTICAL ASSET EVALUATION SYSTEM）系统化管理各大类资产的配置比例。平安大华大类资产配置评价体系（TAES）分析因素具体包括：宏观经济因素、政府政策因素、盈利因素、估值因素、流动性因素和行为因素六个方面，并将各子因素的细分指标划分为先行指标、同步指标和预警指标三类。

本基金严谨衡量不同类别资产的预期风险/收益特征，评估股票市场相对投资价值。在实际投资运作中，不同时期或预期的大类资产配置策略如下：

（1）预期股票市场将趋势上涨，或整体股票市场处于低估值的安全区域，本基金将通过高仓位配置股票资产、低配或者少配债券资产，以增加获取股票市场潜在收益的可能性。

（2）股票市场处于震荡阶段，方向不明确时，本基金将动态调整股票资产、债券资产比例，以波段操作策略为主。重点选择被市场低估的或因市场情绪变化而大幅下跌的行业中的优质个股进行波段操作，追求投资组合的正阿尔法收益。

（3）预期股票市场将趋势下跌，或整体股票市场处于高估值的风险区域，本基金将及时降低股票资产配置比例，最低可至股票资产最低比例。同时适度增加债券资产配置比例，严格控制投资组合风险，避免或减少可能给投资人带来潜在的资本损失。

2、股票投资策略

本基金采用积极主动的投资管理策略，在构建股票投资组合时，灵活运用多种投资策略，积极挖掘和利用市场中可行的投资机会，以实现基金的投资目标。其中，优势主题策略和成长精选策略是基金在股票投资组合构建中的两个主要策略，在基于自上而下的优势主题分析框架下，精选未来具有高成长速度、广阔成长空间、较好成长模式并且成长估值相对合理的个股进行重点投资。同时，本基金将辅以趋势投资和价值反转策略，通过对股票价格与价值相对波动和偏离程度的分析来判断投资时机。

（1）优势主题策略

基于“自上而下”的原则对市场的投资主题进行挖掘，通过运用定量和定性分析方法，深入挖掘市场发展的内在驱动因素以及潜在的投资主题，从中筛选出未来的优势主题，并选择那些受益于优势主题的公司进行重点投资。

具体步骤如下：

①主题发掘。从制度变革、产业调整、技术创新、区域板兴等各个角度出发，分析和挖掘导致这些行业产生变化的根本驱动因素，提前发现值得投资的主题。

②主题遴选。在发现这些主题因素后，对其进行全面的分析和评估。根据这些主题因素对上市公司经营绩效传导的路径和影响程度、受益于该投资主题的行业与产业之数量、受益于该投资主题的上市公司之数量与质量、持续时间的长短等等，遴选出未来具有比较优势的主题。

③主题投资。根据这些优势主题所关联的行业及主题板块，找出与主题投资关联度较高的公司，再做进一步的研究，以确定投资标的。

④主题转换。密切跟踪主题投资的变化情况，在主题投资开始转换时逐步退出原有的投资主题，并发现和挖掘新的投资主题。

（2）成长精选策略

采用GARP选股策略精选股票进行投资，GARP（Growth at a Reasonable Price）是指在合理价格投资成长性股票，追求成长与价值的平衡。即将不同成长类型的股票进行成长性分析，提早发掘其成长潜力或者看到其被低估的价值。

本基金将重点关注以下几类成长性股票：

●传统成长（Classic growth）：优先挑选具有持续、稳定的业绩增长历史，且预期盈利能力将保持增长的公司；

●新兴成长（Rising growth）：对于那处处于成长阶段没有盈利的行业，优先考虑营业收入能够保持增长，且成本控制基本合理的公司；

●周期成长（Cyclical growth）：对于周期类公司，优先考虑市场份额能够保持增长的公司。

●并购成长（Merging growth）：这当考虑并购和重组类机会

在运用GARP选股策略时，重点关注①成长速度，重点选择营业收入和营业利润在行业中未来将保持相对领先增长速度的公司。②成长空间：通过分析公司所处的行业前景，重点集中度和在行业中的地位，选择服务和产品未来具备广阔成长空间的公司。③成长模式：通过对公司的竞争壁垒、内部管理能力、行业属性等进行定性分析，选择业绩增长具有合理基础，在未来能够持续的公司。④成长估值：重点关注PEG<1或低于行业平均水平的公司。

（3）趋势投资策略

趋势投资策略是根据对个股的价格趋势进行分析来把握可行的投资机会，是本基金的辅助投资策略。在运用趋势投资策略时，具体方法有：

①根据个股相对涨跌幅度来进行投资机会的分析。股票价格趋势是不可忽略的一项投资分析要素，因为市场的变化会领先于投资者对市场的认识，而股价趋势是对部分未知或者部分信息的提示，能够作为提醒投资机会与投资错误的依据。本基金的具体应用方法如下：本基金将相对涨跌幅度作为判断价格变化趋势的指标，凡是相对涨跌幅度处于行业内前1/4的公司都将作为价格趋势良好的公司进入基金趋势投资选股的范围，在此基础上再进行公司基本面分析，并构建本基金的趋势投资组合。

②根据动量策略，来进行短期热点机会的把握。国内和国际市场经验均表明，个股股价走势在短期具有连续性；美国股票市场以3至12个月为间隔所构造的股票组合的中间呈连续性，即中间价格具有向某一方向连续的动量效应；而中国股票市场存在强者恒强、弱者恒弱的现象，时间周期在3-24周。本基金将适当运用动量策略捕捉一些短期的投资机会。

（4）价值反转策略

价值反转策略是通过寻找价值被深度低估的股票进行投资，以谋求反转所获得的超额收益。通过“自下而上”的深入公司分析，运用多种指标如PE、PB、PEG、PS、EV/EBITDA等进行相对估值，通过与同行业公司及国际可比公司进行估值比较，找出其中价值被深度低估的公司。

根据市场有效性原理，当某一种投资策略受到投资者的过度追捧时或用该种策略进行投资的有效性就会相对下降。为了避免或减少单一投资策略在不同市场情形下的适应性弊端，本基金通过多维度“策略雷达”对每种投资策略在当前情况下进行适应性评估，捕捉各种投资策略中具备比较价值优势的股票，以此为基础构建本基金的股票投资组合。

3、债券投资策略

本基金可投资的债券品种包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券及可分离转债、中期票据、资产支持证券、次级债和债券回购等债券品种。综合考虑宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势，采取至上而下和至下而上结合的投资策略积极选择和配置债券资产。

本基金在具体债券组合构建时，以利率预期策略、类属资产配置和久期策略为主，以品种选择策略、收益率利差策略和债券置换策略为辅，在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上，构建能获取长期、稳定收益的固定收益类投资组合。

（1）利率预期策略

首先根据对国内外经济形势的预测，分析市场投资环境的变化趋势，重点关注利率趋势变化。通过全面分析宏观经济、货