

信息披露 Disclosure

(上接B045版)

(43) 第一创业证券股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
法定代表人:刘学民
联系人:毛诗莉
电话:0755-23838750
传真:0755-23838750
客服电话:400-888-1888
网址:www.fscs.com
(44) 川财证券有限责任公司
注册(办公)地址:成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17层
法定代表人:孟建军
联系人:匡婷
电话:028-86683063
传真:028-86683063
客户服务电话:028-95105118
公司网址:http://www.ccsc.com
(45) 天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
联系人:崔成
电话:027-87610052
传真:027-87618963
客户服务电话:4008005000
网址:www.tfzq.com
(46) 中信期货有限公司 ? @注册(办公)地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层?
法定代表人:张皓 @联系人:洪诚 ? @电话:0755-23963913? @传真:0755-83217421 ? @客户服务电话:400-990-8826@网址:www.citics.com
(47) 深圳众禄基金销售有限公司
注册(办公)地址:深圳市罗湖区深南东路6047号发展银行大厦25楼1J单元
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
客户服务电话:4006-788-887
网址:众禄基金网 www.zlfund.cn
基金卖网网 www.jjmmw.com
(48) 杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:朱晓晓
电话:021-60897940
传真:0571-26697013
客户服务电话:4000-766-123
?网址:www.fund123.cn
(49) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋
法定代表人:汪静波
联系人:方成
电话:021-38602377
传真:021-38509777
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
(50) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:申万峰
电话:021-20691832
传真:021-20691861
客服电话:400-820-2899
公司网站: www.erichfund.com
(51) 上海好实基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路686弄37号4号楼4494
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
电话:021-58870011
传真:021-68596916
客户服务电话:400 700 9665
网址:www.eshowbuy.com
(52) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人:闫振杰
联系人:宋丽冉
电话:010-62000088
传真:010-62003055
客户服务电话:400-888-6661
网址:www.mylfund.com
(53) 和讯信息科技有限公司
注册(办公)地址:北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王利
联系人:尹洪
联系电话:010-86650920
传真号码:010-86657357
全国统一客服热线:400-920-0022/ 021-20835688
公司网站:licaike.hexun.com
(54) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号东方财富大厦2楼
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509998
传真:021-64386308
客服电话:400-1818-188
网址:http://www.1234567.com.cn
(55) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人:凌顺平
联系人:杨鹏
联系电话:0571-88911818-8565
传真:0571-86900423
客服电话:4008-773-772 0571-88920897
网址:www.5ifund.com
(56) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809室
法定代表人:沈伟伟
联系人:程刚
电话:010-52885713
传真:010-85894285
客户服务电话:400-609-9200
网址:www.yixinfund.com
(57) 北京增财基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:罗细安
联系人:孙晋峰
电话:010-67000988
传真:010-67000988-6000
客户服务电话:400-001-8811
网址:www.zcvc.com.cn
(58) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册(办公)地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场15楼
法定代表人:林松
联系人:袁艳艳
电话:0592- 3122703
传真:0592-8060771
客户服务电话:400-6980-777
网址:www.dkhs.com.cn
(59) 北京展晟天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层
法定代表人:蒋煜
联系人:徐长征、林波
电话:010-58170943、010-58170918
传真:010-58170900
客户服务电话:400-818-8866
网址:www.zhengshiview.com
(60) 嘉实财富管理有限公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期4606-10单元
法定代表人:赵学军
联系人:琪琪
电话:021-2028890
传真:010-85097308
客户服务电话:400-021-8850
网址:www.harvestwm.cn
(61) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区宣武门外大街10号庄胜广场中央办公楼东翼F层
法定代表人:杨晓
电话:0755-88394666
传真:0755-88394677
客户服务电话:400-166-1188
网址:http://8jj.com.cn/
(62) 一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪涛
联系人:段嘉露
电话:010-88312877

传真:010-88312885
客户服务电话:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.com
(63) 北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层?
法定代表人:梁越
联系人:陈静?
电话:010-57756019
传真:010-57756199
客户服务电话:400-778-8868-5
网址:www.chtfund.com
(64) 北京铁银财富投资管理有限公司
注册(办公)地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:赵炎春
联系人:魏争
电话:010-57418829
传真:010-57569671
客户服务电话:400-678-5095
网址:www.tinyfund.com
(65) 深圳开元基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806单元
办公地址:深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806单元
法定代表人:曾军
联系人:廖明莎
电话:0755-33376853
传真:0755-33065516
客户服务电话:4006-877-899
网址:www.tenyuanfund.com
(66) 北京创金启富投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人:梁睿
联系人:张晶晶
电话:010-66154828
传真:010-88067526
客户服务电话:010-88067525
网址:www.51rich.com
(67) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303
法定代表人:王岩
联系人:胡明会
电话:010-59200855
传真:010-59200800
客户服务电话:400-819-9868
网址:www.tdyhfund.com
(68) 上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:张磊
联系人:周丹
电话:021-33323999
传真:021-33323993
客户服务电话:400-820-2819
手机客户端:天天盈基金?
(69) 上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕰川路5475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:沈继伟
联系人:赵海婧
电话:021-50683533
传真:021-50683633
客户服务电话:4000676266
公司网站:www.leadbank.com.cn
(70) 北京新粮仓石基金销售有限公司
注册(办公)地址:北京市海淀区北四环西路58号906室
法定代表人:张欢行
联系人:李昭琛
电话:010-82244185
客户服务电话:010-62675369
网址:http://www.xincail.com/
二、登记机构
名 称:景顺长城基金管理有限公司
住 所:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
法定代表人:赵如冰
电 话:0755-82370388-1668
传 真:0755-22381325
联系人:杨波
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:前卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:吕红、孙睿
联系人:孙睿
四、审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址及主要经营场所: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
执行事务合伙人:Ng Albert Kong Ping 吴港平
电话:010-58153000
传真:010-85188298
经办注册会计师:昌华、陈立群
联系人:李妍明
四、基金的名称
景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
本基金主要通过投资于信用债券类资产,在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益,为投资者提供长期稳定的回报。
七、基金的投资方向
本基金的投资范围包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、资产及收益权转让、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券等金融工具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证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。
本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的80%,其中对信用债券的投资比例不低于非现金基金资产的90%。本基金所指的投资品种包括:短期融资券、企业债、公司债、金融债(不含政策性金融债)、地方政府债、次级债、资产支持证券等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用的固定收益类金融工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。
本基金不直接买入二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场的新股申购或增发新股。
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。
八、基金的投资策略
1.资产配置策略
本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置,把握不同经济发展阶段各类资产的投资机会,根据宏观经济、基准利率水平等因素,预测债券类、货币类大类资产的预期收益率水平,结合各类别资产的流动性以及流动性状况分析,进行大类资产配置。
2.债券类属资产配置
基金管理人根据国债、金融债、企业(公司)债、可分离交易可转债的纯债部分等品种与同期限国债或央票之间收益率利差的扩大和收窄的分析,主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例,降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。
3.债券投资策略
债券投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。
(1)利率预期策略
基金管理人密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势,在此基础上预测市场利率水平变动趋势,以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情景制定相应的债券组合期限结构策略如子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。
(2)信用策略
基金管理人密切跟踪国债、金融债、企业(公司)债等不同债券种类的利差水平,结合各类券种税收状况、流动性状况以及发行人信用质量状况的分析,评定不同债券类属的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类属之间的配置比例。
个券选择层面,基金管理人自建债券研究资料库,并对所有投资的信用品种进行详细的财务分析和非财务分析后,进行各券选择。财务分析方面,以企业财务报表为依据,对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行分析,非财务分析方面(包括管理能力、市场地位和发展前景等指标)则主要通过实地调研和电话会议等形式实现。
(3)时机策略
i 骑乘策略。当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券收益率曲线的下滑,进而获得资本利得收益。
ii 息差策略。利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得资金投资于债券以获取超额收益。
iii 利差策略。对两个期限相近的债券的利差进行分析,从而对利差水平的未来走势做出判断,从而进行相应的债券置换。当预期利差水平缩小时,可以买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券,通过两债券利差的缩小获得投资收益;当预期利差水平扩大时,可以买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券,通过两债券利差的扩大获得投资收益。
4.资产支持证券投资策略
本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产结构以及资产资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期和收益率的影响。同时,管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响,综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。
5、中小企业私募债券投资策略
对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面,本

基金会加强自下而上的分析,将机构评级与内部评级相结合,着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力,尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。
九、业绩比较基准
中证综合债券指数
中证综合债券指数是中证指数公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短期融资券走势的跨市场债券指数,其选样是在中证全债指数样本的基础上,增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,为债券投资者提供更为切合的市场基准是适合作为本基金的业绩比较基准。
如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金,或者未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,在履行相应程序的前提下对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人 和基金托管人协商一致,按有关规定及时公告,并报中国证监会备案,无需经基金份额持有人大会决议。
十、风险收益特征
本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
十一、投资组合报告(未经审计)
景顺长城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。
基金托管人中国建设银行根据基金合同约定,已经复核了本投资组合报告,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2015年6月30日,本报告中所有财务数据未经审计。
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 | 固定收益投资 | 451,156,465.70 | 96.07 |
| | 其中:债券 | 451,156,465.70 | 96.07 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,512,984.56 | 0.96 |
| 7 | 其他资产 | 13,948,108.19 | 2.97 |
| 8 | 合计 | 469,617,558.45 | 100.00 |

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票投资。
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投资。
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 | 17,250,870.40 | 6.83 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 273,757,595.30 | 108.40 |
| 5 | 企业短期融资券 | 80,222,000.00 | 31.76 |
| 6 | 中期票据 | 79,926,000.00 | 31.65 |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 451,156,465.70 | 178.64 |

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 | 120403 | 12豫财债 | 200,000 | 20,702,000.00 | 8.20 |
| 2 | 1390067 | 13泰贤南桥债 | 200,000 | 20,584,000.00 | 8.15 |
| 3 | 1182083 | 11杉杉MTN1 | 200,000 | 20,170,000.00 | 7.99 |
| 4 | 011569160 | 15陕煤SCP003 | 200,000 | 20,142,000.00 | 7.98 |
| 5 | 041456068 | 14三安CP002 | 200,000 | 20,120,000.00 | 7.97 |
| 5 | 1182183 | 11杉杉MTN2 | 200,000 | 20,120,000.00 | 7.97 |

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。
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。
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。
9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
9.1本期国债期货投资策略
根据本基金基金合同约定,本基金投资范围不包括国债期货。
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。
9.3本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。
10. 投资组合报告附注
10.1本报告期末未出现因违反投资的主持主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
10.2本基金本报告期末未持有股票投资。
10.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 14,908.68 |
| 2 | 应收证券清算款 | 999,999.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,731,380.10 |
| 5 | 应收申购款 | 3,201,920.41 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 13,948,108.19 |

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。
10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票投资。
十二、基金的投资业绩
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2015年6月30日。
1. 净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|------------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 2013年8月26日至2013年12月31日 | 0.60% | 0.06% | -1.58% | 0.09% | 2.18% | -0.01% |
| 2014年1月1日至2014年12月31日 | 9.84% | 0.17% | 9.75% | 0.09% | 0.09% | 0.09% |
| 2015年1月1日至2015年6月30日 | 5.97% | 0.10% | 3.07% | 0.08% | 2.90% | 0.02% |
| 2013年8月26日至2015年6月30日 | 17.10% | 0.14% | 11.33% | 0.09% | 5.77% | 0.05% |

景顺长城景兴信用纯债债券类C类

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2013年8月26日至2013年12月31日 | 0.50% | 0.07% | -1.58% | 0.09% | 2.08% | -0.02% |
| 2014年1月1日至2014年12月31日 | 9.15% | 0.17% | 9.75% | 0.08% | -0.60% | 0.09% |
| 2015年1月1日至2015年6月30日 | 5.83% | 0.10% | 3.07% | 0.08% | 2.76% | 0.02% |
| 2013年8月26日至2015年6月30日 | 16.10% | 0.14% | 11.33% | 0.09% | 4.77% | 0.05% |

2. 自基金合同生效以来基金累计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

节假日、公休假期、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0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.2\% \times \text{当年天数}$$
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,基金管理人 与基金托管人核对后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
3.基金销售服务费
本基金A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。
销售服务费按前一日C 类基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.4\% \times \text{当年天数}$$
H 为C 类基金份额每日应计提的销售服务费
E 为C 类基金份额前一日基金资产净值
销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,基金管理人与基金托管人核对后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
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。
二、基金销售有关的费用
1.基金认购费用
(1) 本基金A 类基金份额在投资者认购时收取认购费,C 类基金份额在认购时不收取认购费。投资者在认购A 类基金份额时需缴纳的认购费率按认购金额递减。投资者认购需全额缴纳认购费用。认购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。投资者在一天之内如果有多笔认购,适用费率按笔分别计算。
本基金对通过直销中心认购的养老金客户与此之外的其他投资者实施差别的认购费率。
拟实施特定申购费率的养老金客户范围包括基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老金,包括:
1、全国社会保障基金;
2、可以投资基金的地方社会保障基金;
3、企业年金单一计划以及集合计划。
如将来出现经养老金监管部门认可的新养老基金类型,基金管理人 也拟将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。
通过基金管理人 的直销中心认购本基金A 类基金份额的养老金客户认购费率见下表:

| 认购金额(M) | A类份额认购费率 |
|-----------------|----------|
| M < 50万 | 0.24% |
| 50万 ≤ M < 200万 | 0.12% |
| 200万 ≤ M < 500万 | 0.04% |
| M ≥ 500万 | 1000元/笔 |

其他投资者认购本基金A 类基金份额认购费率见下表:

| 认购金额(M) | A类份额认购费率 |
|-----------------|----------|
| M < 50万 | 0.60% |
| 50万 ≤ M < 200万 | 0.30% |
| 200万 ≤ M < 500万 | 0.10% |
| M ≥ 500万 | 1000元/笔 |

(2)计算公式
①认购A 类基金份额时,认购份数的计算方法如下:
当认购费用适用比例费率时:

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购期间利息}) / \text{基金份额初始面值}$$
当认购费用适用固定金额时:

$$\text{认购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} - \text{认购费用}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购期间利息}) / \text{基金份额初始面值}$$
②认购C 类基金份额时,认购份数的计算方法如下:

$$\text{认购费用} = (\text{认购金额} + \text{认购期间利息}) / \text{基金份额初始面值}$$
基金认购采取金额认购的方式,认购金额计算结果按照四舍五入的方法,保留小数点后两位,认购份额计算结果按尾数舍去的方法,保留小数点后两位,舍去部分所代表的资产归基金所有。
2.基金申购费用
(1) 本基金基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用。在申购时收取的申购费称为前端申购费。
投资者在申购A 类基金份额时需缴纳的申购费率按申购金额递减。
本基金对通过直销中心申购的养老金客户与此之外的其他投资者实施差别的申购费率。
通过基金管理人的直销中心申购本基金A类基金份额的养老金客户申购费率见下表:

| 申购金额(M) | A类份额申购费率 |
|-----------------|----------|
| M < 50万 | 0.32% |
| 50万 ≤ M < 200万 | 0.16% |
| 200万 ≤ M < 500万 | 0.08% |
| M ≥ 500万 | 1000元/笔 |

其他投资者申购本基金A类基金份额的申购费率见下表:

| 申购金额(M) | A类份额申购费率 |
|-----------------|----------|
| M < 50万 | 0.80% |
| 50万 ≤ M < 200万 | 0.40% |
| 200万 ≤ M < 500万 | 0.20% |
| M ≥ 500万 | 1000元/笔 |

投资者如申购C 类基金份额,则申购费为0。本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用,不列入基金财产。
(2)计算公式
A 类基金份额申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后,以申请当日A 类基金份额净值为基准计算,申购份额的计算结果按尾数舍去的方法,保留小数点后两位,舍去部分所代表的资产归基金所有。
本基金的A 类基金份额申购金额包括申购费用和净申购金额。其中,
当申购费用适用比例费率时:

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日基金份额净值}$$
当申购费用适用固定金额时:

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日基金份额净值}$$
C 类基金份额申购的有效份额为按实际确认的申购金额,以申请当日C类基金份额净值为基准计算,计算结果按尾数舍去的方法,保留小数点后两位,舍去部分所代表的资产归基金所有。
本基金的C 类基金份额申购时不收取申购费用,申购金额即为净申购金额。

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日基金份额净值}$$
3.基金赎回费用
(1) A 类基金份额及C 类基金份额均收取赎回费,赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。
赎回费率具体如下表所示:

| A类基金份额赎回 | C类基金份额赎回 |
|-------------|----------|
| 30天以内 | 0.30% |
| 30天以上(含)-1年 | 0.30% |
| 1年以上(含)-2年 | 0.05% |
| 2年以上(含) | 0 |

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中不低于25%的部分归入基金财产,其余部分用于支付登记费和其他必要的手续费。
(2)计算公式
A 类基金份额及C 类基金份额赎回金额为按实际确认的有效赎回金额乘以申请当日基金份额净值的金额,净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额,各计算结果均按照四舍五入方法,保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。
本基金A 类基金份额及C 类基金份额的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中,

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$
4.基金转换费用
(1) 本基金的转换费用由赎回费和申购补差费组成,转出时收取赎回费,转入时收取申购补差费。其中赎回费的收取标准遵循本招募说明书的约定,申购补差费的收取标准为:申购补差费= MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用- 转出净额在转出基金中对应的申购费用,0】。
(2)计算公式
①基金转出时赎回费的计算:
由股票基金转出时:

$$\text{转出总额} = \text{转出份额} \times \text{转出基金当日基金份额净值}$$
由货币基金转出时:

$$\text{转出总额} = \text{转出份额} \times \text{转出基金当日基金份额净值} + \text{待结转收益(全额转出时)}$$
赎回费用 = 转出总额 × 转出基金赎回费率

$$\text{转出净额} = \text{转出总额} - \text{赎回费用}$$
②基金转入时申购补差费的计算:

$$\text{净转入金额} = \text{转出净额} - \text{申购补差费}$$
其中,申购补差费 = MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用- 转出净额在转出基金中对应的申购费用,0】
转入份额 = 净转入金额 / 转入基金当日基金份额净值
三、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。
十四、对招募说明书更新的部分说明
在“第三部分,基金管理人”部分,更新了基金