（上接B081版）

155	济安财富（北京）基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室 办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层 法定代表人：杨健 联系人：李海燕 电话：010-65309516 传真：010-65330699 客户服务电话：400-673-7010 网址：www.jianfortune.com
156	华信期货股份有限公司 （注：仅代销景系列之优选混合型证券投资基金、动力平衡证券投资基金）	注册地址：郑州市郑东新区商务内环路27号楼1单元3层01号、2单元3层02号 办公地址：郑州市郑东新区商务内环路27号楼1单元3层01号、2单元3层02号 法定代表人：张岩 联系人：李玉磊 电话：0371-69106682 传真：0371-69106655 客户服务电话：400-6197-666 网址：http://www.cefcfco.com/
157	洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司	注册地址：山东省青岛市香港东路195号9号楼701室 办公地址：北京市西城区西什库大街31号院九思文创园5号楼501室 法定代表人：任淑桢 联系人：周映筱 电话：010-66162800 传真：0532-66728591 客户服务电话：4006706863 网址：www.hongtaiwealth.com
158	上海有鱼基金销售有限公司	注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室 办公地址：上海徐汇区桂平路391号B座19层 法定代表人：林琼 联系人：徐海峥 电话：021-60907379 传真：021-60907397 客户服务电话：021-60907378 网址：www.youyufund.com
159	深圳盈信基金销售有限公司	注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1（811-812） 办公地址：大连市中山区南山路155号南山1910小区A3-1 法定代表人：苗宏升 联系人：王清臣 电话：0411-66889805 传真：0411-66889827 客户服务电话：4007-903-688
160	扬州国信嘉利基金销售有限公司 （注：仅代销景系列之动力平衡证券投资基金）	注册地址：江苏省扬州市广陵新城信息产业基地3期20B栋 办公地址：江苏省扬州市邗江区文昌西路56号公元国际大厦320 法定代表人：刘晓光 联系人：苏曦 电话：0514-82099618-805 客户服务电话：400-021-6088 网址：https://www.gxjlcn.com/
161	中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司 （注：仅代销景系列之优选混合型证券投资基金）	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号729S室 办公地址：上海市虹口区公平路18号8栋嘉昱大厦6层 法定代表人：许欣 联系人：屠帅颖 电话：021-68609600-5905 传真：021-33830351 客户服务电话：400-700-9700（钱滚滚专线） 网址：https://www.qiangungun.com/
162	民商基金销售（上海）有限公司	注册地址：上海黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室 办公地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼 法定代表人：贲惠琴 联系人：钟伟 电话：138-2642-0174 传真：021-50206001 客户服务电话：021-50206003 网址：http://www.msftec.com/
163	腾安基金销售（深圳）有限公司 （注：仅代销景系列之优选混合型证券投资基金、动力平衡证券投资基金）	注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大楼15楼 法定代表人：刘明军 联系人：谭广锋 电话：95017转1转8 客户服务电话：95017转1转8 网址：www.tenganxinxi.com

注：1、目前华侨银行东亚银行和钱滚滚代销景顺长城优选混合型证券投资基金，暂不代销景顺长城动力平衡证券投资基金和景顺长城货币市场证券投资基金。

2、目前南京银行代销景顺长城优选混合型证券投资基金和景顺长城货币市场证券投资基金，暂不代销景顺长城动力平衡证券投资基金。

3、目前星展银行、上海农商行和中原银行代销景顺长城货币市场证券投资基金，暂不代销景顺长城动力平衡证券投资基金和景顺长城优选混合型证券投资基金。

4、目前恒丰银行、微众银行、、和信投顾、华信期货和腾安基金代销景顺长城优选混合型证券投资基金和景顺长城动力平衡证券投资基金，暂不代销景顺长城货币市场证券投资基金。

5、目前国信嘉利代销景顺长城动力平衡证券投资基金，暂不代销景顺长城优选混合型证券投资基金和景顺长城货币市场证券投资基金。

基金管理人可根据《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

（二）注册登记人
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
法定代表人：丁益
电话：（0755）82370388－1902
传真：（0755）22381325
联系人：曹竞

（三）律师事务所及经办律师
名称：北京市金诚同达律师事务所
住所：北京建国门外大街甲24号东海中心17层
负责人：田予
电话：（010）65155566
传真：（010）65263519
经办律师：贺宝银、徐志浩

（四）会计师事务所及经办注册会计师
法定名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址：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：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：朱宏宇
经办注册会计师：许康玮、朱宏宇

四、基金的名称
景顺长城景系列开放式证券投资基金

五、基金的类型
契约型开放式

六、货币市场基金份额的分级

本系列基金下设货币市场基金自2010年4月30日起实行基金份额分级，根据投资者持有货币市场基金的份额等级适用不同的销售服务费率。自2010年4月30日起，货币市场基金分设两级基金份额：A级基金份额和B级基金份额。两级基金份额分设不同基金代码，两级基金份额单独公布每万份基金净收益和基金七日年化收益率。

基金费率及分级规则

1、A级与B级基金份额的交易限额和适用费率如下表所示：

	A级基金份额	B级基金份额
申购费	0	0
赎回费	0	0
销售服务费	0.25%	0.01%
首次申购最低金额	1元	1元
追加申购最低金额	不限	不限
定期定额申购最低金额	1元	不适用
单笔赎回最低限额	0.01份	0.01份
单个基金账户保留的最低持有份额	不适用	500万份
在销售机构保留的最低持有份额	1份	1份

注：货币市场基金当期基金收益结转基金份额，不受最低申购金额的限制，货币市场基金B级基金份额暂不开通定期定额投资计划。

2、份额分级规则：

基金份额分级后，在基金存续期内的任何一个开放日，单个基金账户内保留的货币市场基金份额超过500万份（包含500万份）时，注册登记机构将自动升级其单个基金账户内持有的可用基金份额为B级基金份额，未结转收益将不结转，一并带入B级份额，并于升级当日适用B级的相关费率。

基金份额分级后，在基金存续期内的任何一个开放日，单个基金账户内保留的货币市场基金份额低于500万份（不含500万份）时，注册登记机构将自动降级其单个基金账户内持有的可用基金份额为A级基金份额，未结转收益将不结转，一并带入A级份额，并于降级当日适用A级的相关费率。

基金份额分级规则自2010年4月30日起生效，自该日起，注册登记机构将根据投资者基金账户所持有的货币市场基金份额数量，进行份额级别判断和处理，并适用A、B级相关费率。

基金份额分级后，对在开放日参与基金份额升降级确认的投资者，其在当日提交的货币市场基金转换转出、转托管转出等申请，注册登记机构将在下一开放日做失败确认处理。

七、基金的转换

（一）本系列基金的转换费用

1、本系列基金的转换费率最高不超过 1.5%。

2、本系列基金转换费在扣除注册登记费用及其他基本手续费后，剩余部分归基金财产。对于基金份额持有人转出持有期不足7日的优选混合型基金或动力平衡基金，其收取不低于1.5%的赎回费，并将前述赎回费全额归入对应基金的基金财产。

3、本系列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】。

（二）转换交易的计算方式

本系列基金的转换交易包括了基金转出和基金转入，其中：

①基金转出时赎回费的计算：

由优选混合型基金或动力平衡基金转出时：

转出总额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值

由货币基金转出时：

转出总额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值+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

转出净额＝转出总额－赎回费用

②基金转入时申购补差费的计算：

净转入金额＝转出净额－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

例：投资者申请将持有的优选混合型基金10,000份转换为景顺长城内需增长开放式证券投资基金，假设转换当日优选混合型基金的基金份额净值为1.148元，投资者持有该基金18个月，对应赎回费为0.25%，申购费为1.5%，内需增长基金的基金份额净值为1.163元，申购费为1.5%，则投资者转换后可得到的内需增长基金份额为：

转出总额＝10,000×1.148＝11,480元
赎回费用＝11,480×0.25%＝28.70元
转出净额＝11,480－28.7＝ 11,451.3元
转出净额在转入基金中对应的净申购金额=11,451.3/1.015=11,282.07元
转出净额在转入基金中对应的申购费用=11,451.3－11,282.07=169.23元
转出净额在转出基金中对应的净申购金额=11,451.3/1.015=11,282.07元
转出净额在转出基金中对应的申购费用=11,451.3－11,282.07=169.23元
净转入金额＝11,451.3－MAX【169.23－169.23，0】=11,451.3元
转入份额＝11,451.3 / 1.163＝9,846.34份

八、基金的投资目标

本系列基金的投资目标是：运用专业化的投资管理，为投资者提供长期稳定并可持续的资本增值。各基金投资目标如下：

1、优选混合型基金利用"景顺长城股票数据库"对股票进行精密和系统的分析，构建具有投资价值的股票组合，力求为投资者提供长期的资本增值。

2、货币市场基金在保持本金的高流动性和安全性的前提下，获得高于基准的投资回报。

3、动力平衡基金以获取高于业绩比较基准的回报为目标，注重通过动态的资产配置以达到当期收益与长期资本增值的兼顾，争取为投资者提供长期稳定的回报。

九、基金的投资方向

本系列基金下设的优选混合型基金和动力平衡基金的投资范围包括股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的A股；债券投资的范围包括国债、金融债、企业债与可转换债券等。

本系列基金下设的货币市场基金投资于以下金融工具：
1、现金；
2、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；
3、剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；
4、期限在一年以内（含一年）的债券回购；
5、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；
6、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

十、基金的投资策略

1、资产配置

本系列基金下优选混合型基金和动力平衡基金均有债券和股票资产，但是配置比例显著不同：

优选混合型基金	动力平衡基金
股票：70－80% 债券：20－30%	股票：20－80% 债券：20－80%

*百分比为占基金资产净值比例。

2、优选混合型基金和动力平衡基金的股票选择及组合构建

（1）投资流程

在构建和管理投资组合过程中，这两只基金主要采取"自下而上"的投资策略，着重选择基本面良好或价值被过分低估的股票。同时，也会结合"自上而下"的投资策略，即基于对宏观经济运行状况及政策分析、金融货币运行状况及政策分析、产业运行景气状况及政策分析、行业偏好选择，进而结合证券市场状况和政策分析，做出资产配置及组合构建的决定。

（2）选股原则

股票投资以成长、价值及收益为基础，在合适的价位买入具有高成长性的成长型股票、价值被市场低估的价值型股票以及能提供稳定收益的收益型股票。

（3）选股程序

①通过"景顺长城股票数据库"的详细分析与其他深入的研究，如实地考察、电话会议、行业分析等，判断股票是否值得投资，然后组建"股票买进名单"；

②在深入研究的基础上（包括对各种量化指标的分析，结合各券商的投资分析报告），综合公司的分析判断，做出对所研究股票的投资结论，并持续维护"股票买进名单"；

③根据基金的投资目标、投资限制和投资策略等要求，考虑收益和风险的配比、股票的流动性以及其它因素，推荐不同基金的股票买进名单。

3、债券选择和组合构建

（1）投资流程

本系列基金下各基金债券投资部分着重本金安全性和流动性。综合分析宏观经济形势，并对货币政策与财政政策以及社会政治状况等进行研究，着重利率的变化趋势预测，建立对收益率曲线变动的预测模型。通过该模型进行估值分析，确定价格中枢的变动趋势；同时，计算债券投资组合久期、到期收益率和期限等指标，进行"自下而上"的债券和债券品种配置。

（2）债券投资组合管理

①组合久期管理：为了充分地控制利率变动风险，需要及时对债券投资组合进行调整。当预测利率将上升时，本系列基金将缩短组合债券的平均久期，持有短期债券、浮动债等来减低利率风险；反之，当预测利率将下降时，本系列基金将增大组合的平均久期并增持长期债券来提高组合的收益水平。在组合久期确定后，本系列基金将通过不同期限债券的匹配组合， 从价格的相对变化中获得较高的收益。

②资产配置：在未来利率走势预期的基础上，本系列基金通过久期与凸性管理的手段，在不同期限的债券以及固息债与浮息债之间进行配置。同时，本系列基金以市场规模、收益率与流动性为基础，在不同市场以及不同的债券类别之间进行配置。

③债券选择

本系列基金在考虑信用质量和期限等因素后，将选择以下类型的债券：
●到期收益率较高、具有较好流动性的债券
●有较高当期收入的债券
●有增值潜力、价格被低估（即收益率和久期过分偏离合理水平）的债券
●预期信用质量将得到改善的金融债或企业债券
●期权和债性突出的可转换债
●收益率水平合理的新券或者市场尚未正确定价的创新品种

④组合构建：本系列基金通过宏观经济分析，对利率走势做出判断，在此基础上对各类资产进行合理配置。同时，本系列基金根据收益率和流动性、债券资质"自下而上"地进行个券选择，组成最终的投资组合。在确定具体个券后，须依据下列标准构建投资组合：
●确保执行投资策略并确保投资组合久期在规定的范围内
●保持投资组合分散化，基金持有单一债券品种不得超过基金净值的10%
●保持投资组合的流动性，以满足基金正常现金流的需要
●控制投资组合风险在一定的范围内
●债券投资组合中，债券信用等级最低为BBB+或同等信用，投资组合的平均信用等级应在AA+或以上

⑤组合优化：在债券组合管理中开发出独有的程序对债券组合定期进行量化分析，包括精确计算组合的VAR值、贡献分析、跟踪误差等指标，根据量化分析结果对债券组合品种进行相应的配置调整，并通过了解组合的风险特征、预算，按照宏观经济分析模型预测和企业信用分析的结果，对组合做出连续的优化调整。

⑥现金和回购资产：保留足够的现金以应付基金日常的现金需要。

4、货币市场基金的投资决策程序和方法：

（1）投资决策程序

①基金经理依据投资部对宏观经济、货币政策、财政政策以及市场资金供求状况的综合分析，对短期利率变化趋势做出判断，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议；

②投资决策委员会审核基金经理提交的资产配置建议，并最终决定资产配置方案；

③基金经理对各投资品种进行收益率、流动性、信用风险、平均剩余期限分析，同时根据未来利率变化的预期以及投资品种的利率敏感性来综合评定各品种的投资价值；

④基金经理结合经审定的资产配置方案、基金日常申购、赎回情况进行具体的投资组合构建。

⑤投资决策委员会审核重大基金投资组合方案，如无异议，由基金经理具体执行投资计划。

（2）投资管理方法

①深入分析宏观经济、货币政策和市场资金供求变化，对短期利率走势形成合理预期，并据此调整基金的资产配置策略。

②通过利率预期策略，确定组合的平均剩余期限和各类资产的配置比例。

③通过流动性管理策略，在保持基金资产高流动性的前提下，确保基金的稳定收益。

④以严谨的研究分析为基础，积极实施市场套利策略。

本系列基金会持续地进行定期与不定期的投资组合回顾与风险监控，适时做出相应调整。

十一、基金的业绩比较基准

优选混合型基金：中证800指数×80%＋中国债券总指数×20%。

货币市场基金：税后同期7天存款利率。

动力平衡基金：沪深300指数收益率×50%＋中国债券总指数收益率×45%＋同业存款利率×5%。

如果今后市场出现更具代表性的业绩比较基准，在与基金托管人协商一致后，本基金管理人可调整或变更业绩比较基准。

十二、基金的风险收益特征

优选混合型基金：是一种具有较高波动性和较高风险的投资工具。适合风险承受能力强、追求高投资回报的投资者。

货币市场基金具有低风险和收益稳定的特点，投资目标是在保持本金的高流动性和安全性的前提下，获得高于基准的投资回报。

动力平衡基金：是一种具有中等风险的投资工具，除了结合以上景顺长城股票及债券基金的风险管理程序以外，为达到平稳回报的目的，该基金还将独立对风险来源进行评估，并设立额外的风险控制管理手段。

十三、基金投资组合报告（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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，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2018年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

优选混合型基金投资组合报告

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	3,011,182,091.83	73.29
	其中：股票	3,011,182,091.83	73.29
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	822,373,000.00	20.01
	其中：债券	822,373,000.00	20.01
	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	158,368,893.18	3.85
8	其他资产	116,896,135.18	2.85
9	合计	4,108,820,120.19	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	1,859,321,160.52	46.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	190,522,656.99	4.78
G	交通运输、仓储和邮政业	549,089,600.37	13.78
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	278,995,440.36	7.00
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	38,376,210.93	0.96
M	科学研究和技术服务业	438,779.55	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	5,922.96	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	94,432,320.15	2.37
S	综合	–	–
	合计	3,011,182,091.83	75.60

2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002841	视源股份	3,868,008	232,854,081.60	5.85
2	300323	华灿光电	19,298,285	201,667,078.25	5.06
3	600115	东方航空	35,016,917	196,094,735.20	4.92
4	300413	芒果超媒	5,648,463	190,522,656.99	4.78
5	601111	中国国航	23,240,881	189,413,180.15	4.76
6	002382	蓝帆医疗	9,452,612	187,634,348.20	4.71
7	601601	中国太保	5,177,194	183,842,158.94	4.62
8	300482	万孚生物	5,456,804	175,217,976.44	4.40
9	603788	宁波高发	9,053,141	171,647,553.36	4.31
10	603885	吉祥航空	12,336,477	163,581,685.02	4.11

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	822,373,000.00	20.65
	其中：政策性金融债	822,373,000.00	20.65
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	822,373,000.00	20.65

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	180207	18国开07	2,200,000	220,528,000.00	5.54
2	180201	18国开01	1,500,000	150,660,000.00	3.78
3	160415	16农发15	1,500,000	150,015,000.00	3.77
4	180209	18国开09	1,100,000	110,187,000.00	2.77
5	180404	18农发04	500,000	50,245,000.00	1.26

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股指期货交易情况说明

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

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。

10.2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。

10.3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。

11.投资组合报告附注

11.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行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。

11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,686,686.00
2	应收证券清算款	100,313,795.36
3	应收股利	–
4	应收利息	14,578,898.41
5	应收申购款	316,755.41
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	116,896,135.18

11.4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。

11.5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。

11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

货币市场基金投资组合报告

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	固定收益投资	183,922,628.27	45.38
	其中：债券	183,922,628.27	45.38
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	64,428,726.64	15.90
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	145,419,876.46	35.88
4	其他资产	11,499,117.16	2.84
5	合计	405,270,348.53	100.00

注：银行存款和结算备付金其中包含货币基金定期存款144,100,000.00元。

2.报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	0.66
	其中：买断式回购融资	–

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中：买断式回购融资	–	–

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3.基金投资组合平均剩余期限

3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	70
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	72
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内，本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	34.08	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	21.77	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	12.25	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	–	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天（含）	29.32	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	97.42	–

4.报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内，本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过240天。

5.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（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	30,010,561.46	7.42
	其中：政策性金融债	30,010,561.46	7.42
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	59,999,633.22	14.84
6	中期票据	–	–
7	同业存单	93,912,433.59	23.23
8	其他	–	–
9	合计	183,922,628.27	45.50
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

6.报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	111813046	18浙商银行CD046	600,000	59,161,610.76	14.64
2	071800033	18招商CP003	300,000	30,000,459.48	7.42
3	150223	15国开23	200,000	20,005,075.56	4.95
4	011801209	18中电投SCP018	200,000	20,000,091.52	4.95
5	111807114	18招商银行CD114	200,000	19,760,468.77	4.89
6	111816107	18上海银行CD107	150,000	14,990,354.06	3.71
7	150317	15进出17	100,000	10,005,485.90	2.48
8	071800029	18中信CP007BC	100,000	9,999,082.22	2.47

7."影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0697%
报告期内偏离度的最低值	0.0188%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0414%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内，本货币基金未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内，本货币基金未发生正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

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。

9.投资组合报告附注

9.1

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值为1.0000 元。

9.2

1.2018年2月12日，因招商银行股份有限公司（以下简称"招商银行"，股票代码：600036）内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等问题，中国银行保险监督管理委员会依据《商业银行内部控制指引》第十三条、《中国银监会关于加大防范操作风险工作力度的通知》第三条、《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条等规定，出具银监罚决字（2018）1号行政处罚决定书，处招商银行罚款6570万元，没收违法所得3.024万元，罚没合计6573.024万元。

本基金投研人员认为，招商银行作为全国性股份制商业银行，截至2018年6月底净资本5746亿元，资本充足率15.08%，本次处罚规模相比其资本而言较小，对其资本规模及信用资质影响较小。基于以上判断，本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对招商银行同业存单进行了投资。

2. 其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

9.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	2,949,916.83
4	应收申购款	8,549,200.33
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	11,499,117.16

9.4投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

动力平衡基金投资组合报告

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	927,989,845.35	68.15
	其中：股票	927,989,845.35	68.15
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	320,927,000.00	23.57
	其中：债券	320,927,000.00	23.57
	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	89,831,893.02	6.60
8	其他资产	23,005,857.64	1.69
9	合计	1,361,754,596.01	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	673,287,200.24	49.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	106,448,589.00	7.84
K	房地产业	123,870,353.11	9.13
L	租赁和商务服务业	24,383,703.00	1.80
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	927,989,845.35	68.38

2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002304	洋河股份	848,768	108,642,304.00	8.01
2	601318	中国平安	1,553,994	106,448,589.00	7.84
3	000568	泸州老窖	1,947,292	92,515,842.92	6.82
4	002572	索菲亚	3,493,658	76,336,427.30	5.62
5	600519	贵州茅台	98,531	71,927,630.00	5.30
6	601155	新城控股	2,563,327	67,133,534.13	4.95
7	600340	华夏幸福	2,239,906	56,736,818.98	4.18
8	603899	晨光文具	1,790,488	55,594,652.40	4.10
9	000651	格力电器	902,577	36,283,595.40	2.67
10	600196	复星医药	1,125,989	35,524,952.95	2.62

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	320,927,000.00	23.65
	其中：政策性金融债	320,927,000.00	23.65
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	320,927,000.00	23.65

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	180301	18进出01	900,000	90,360,000.00	6.66
2	180404	18农发04	800,000	80,392,000.00	5.92
3	180209	18国开09	500,000	50,085,000.00	3.69
4	170311	17进出11	500,000	50,045,000.00	3.69
5	150317	15进出17	200,000	20,026,000.00	1.48

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股指期货交易情况说明

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

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。

10.2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。

10.3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。

11.投资组合报告附注

11.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行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。

11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	319,473.37
2	应收证券清算款	14,016,240.00
3	应收股利	–
4	应收利息	8,198,270.68
5	应收申购款	471,873.59
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	23,005,857.64

11.4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。

11.5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。

11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

十四、基金的业绩

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。基金的过往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系列基金的招募说明书和更新招募说明书。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，已经复核了下列财务指标、净值表现等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

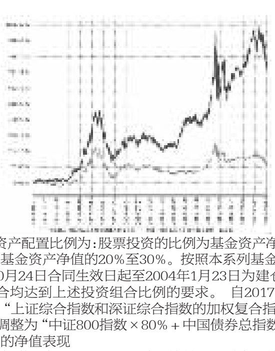
基金业绩数据截止2018年9月30日。

优选混合型基金的净值表现

1、基金份额净值增长率及其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）
2003年10月24日－2003年12月31日	6.75%	0.62%	4.62%	0.97%	2.13%	−0.35%
2004年	7.63%	0.95%	−12.93%	1.07%	20.56%	−0.12%
2005年	3.32%	0.93%	−5.27%	1.12%	8.59%	−0.19%
2006年	130.58%	1.19%	92.74%	1.07%	37.84%	0.12%
2007年	96.12%	1.78%	79.80%	1.76%	16.32%	0.02%
2008年	−51.92%	2.19%	−54.74%	2.28%	2.82%	−0.09%
2009年	53.25%	1.49%	64.78%	1.53%	−11.53%	−0.04%
2010年	−1.09%	1.30%	−7.70%	1.15%	6.61%	0.15%
2011年	−19.82%	1.01%	−18.76%	0.96%	−1.06%	0.05%
2012年	14.29%	1.11%	3.07%	0.92%	11.22%	0.19%
2013年	39.69%	1.35%	−1.04%	0.94%	40.73%	0.41%
2014年	9.40%	1.17%	39.95%	0.84%	−30.55%	0.33%
2015年	61.02%	2.67%	20.58%	1.95%	40.44%	0.72%
2016年	−8.28%	1.70%	−9.90%	1.25%	1.62%	0.45%
2017年	27.72%	0.84%	6.43%	0.52%	21.29%	0.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	−7.63%	1.17%	−10.25%	0.93%	2.62%	0.24%
2018年1月1日至2018年9月30日	−14.37%	1.19%	−12.55%	0.97%	−1.82%	0.22%
2003年10月24日－2018年9月30日	785.21%	1.48%	141.31%	1.31%	643.90%	0.17%

2、自基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动的比较



注：本基金的资产配置比例为：股票投资的比例为基金资产净值的70%至80%；债券投资的比例为基金资产净值的20%至30%。按照本系列基金基金合同的规定，本基金自2003年10月24日合同生效日起至2004年1月23日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。 自2017年9月6日起，本基金业绩比较基准由"上证综合指数和深证综合指数的加权复合指数×80%+中国债券总指数×20%"调整为"中证800指数×80%＋中国债券总指数×20%"。

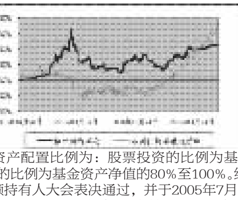
恒丰债券基金的净值表现

1、基金份额净值增长率及其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）
2003年10月24日－2003年12月31日	0.51%	0.02%	1.71%	0.34%	−1.20%	−0.32%
2004年	1.35%	0.20%	−2.42%	0.35%	3.77%	−0.15%
2005年01月01日－2005年07月14日	2.51%	0.11%	8.03%	0.21%	−5.52%	−0.10%
2003年10月24日－2005年07月14日	4.42%	0.17%	7.23%	0.31%	−2.81%	−0.14%

2、自基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动的比较

恒丰债券基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较图
（2003年10月24日至2005年7月14日）



备注：本基金的资产配置比例为：股票投资的比例为基金资产净值的0%至20%；债券投资和现金的比例为基金资产净值的80%至100%。经景顺长城恒丰债券证券投资基金基金份额持有人大会表决通过，并于2005年7月7日获中国证券监督管理委员会证监基金字2005[121]号文核准，本基金以2005年7月14日为转变基准日转变成为景顺长城货币市场证券投资基金。

货币市场基金的净值表现

1、基金收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较表

货币基金A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
2005年7月15日－2005年12月31日	0.8862%	0.0033%	0.8384%	0.0000%	0.0478%	0.0033%
2006年	1.8290%	0.0029%	1.8798%	0.0003%	−0.0508%	0.0026%
2007年	3.1186%	0.0057%	2.7851%	0.0019%	0.3335%	0.0038%
2008年	3.4738%	0.0055%	3.7621%	0.0012%	−0.2883%	0.0043%
2009年	1.1973%	0.0030%	2.2500%	0.0000%	−1.0527%	0.0030%
2010年	1.1310%	0.0042%	1.6434%	0.0012%	−0.5124%	0.0030%
2011年	2.2634%	0.0042%	1.4597%	0.0001%	0.8037%	0.0041%
2012年	3.3451%	0.0037%	1.4178%	0.0002%	1.9273%	0.0035%
2013年	3.5239%	0.0046%	1.3500%	0.0000%	2.1739%	0.0046%
2014年	4.1998%	0.0051%	1.3500%	0.0000%	2.8498%	0.0051%
2015年	3.1473%	0.0084%	1.3500%	0.0000%	1.7973%	0.0084%
2016年	2.1350%	0.0029%	1.3500%	0.0000%	0.7850%	0.0029%
2017年	3.7174%	0.0026%	1.3500%	0.0000%	2.3674%	0.0026%
2018年1月1日至2018年6月30日	1.7541%	0.0026%	0.6695%	0.0000%	1.0846%	0.0026%
2018年1月1日至2018年9月30日	2.4950%	0.0026%	1.0097%	0.0000%	1.4853%	0.0026%
2005年7月15日－2018年9月30日	43.2246%	0.0064%	23.7960%	0.0020%	19.4286%	0.0044%

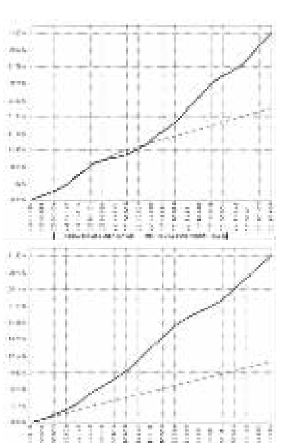
注：本基金的收益分配为每日分配，按月结转份额。

货币基金B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
2010年4月30日－2010年12月31日	1.0445%	0.0047%	0.9099%	0.0000%	0.1346%	0.0047%
2011年	2.5092%	0.0042%	1.4597%	0.0001%	1.0495%	0.0041%
2012年	3.5922%	0.0037%	1.4178%	0.0002%	2.1744%	0.0035%
2013年	3.7712%	0.0047%	1.3500%	0.0000%	2.4212%	0.0047%
2014年	4.4489%	0.0051%	1.3500%	0.0000%	3.0989%	0.0051%
2015年	3.3953%	0.0084%	1.3500%	0.0000%	2.0453%	0.0084%
2016年	2.3802%	0.0029%	1.3500%	0.0000%	1.0302%	0.0029%
2017年	3.9653%	0.0026%	1.3500%	0.0000%	2.6153%	0.0026%
2018年1月1日至2018年6月30日	1.8752%	0.0026%	0.6695%	0.0000%	1.2057%	0.0026%
2018年1月1日至2018年9月30日	2.6789%	0.0026%	1.0097%	0.0000%	1.6692%	0.0026%
2010年4月30日－2018年9月30日	31.4196%	0.0059%	11.5470%	0.0001%	19.8726%	0.0058%

注：本基金的收益分配为每日分配，按月结转份额。

2、自基金转型以来基金累计净值收益率变动情况及与同期业绩比较基准的变动的比较



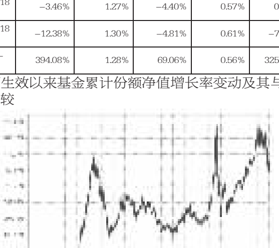
注：经景顺长城恒丰债券证券投资基金基金份额持有人大会表决通过，并于2005年7月7日获中国证券监督管理委员会证监基金字2005[121]号文核准，景顺长城恒丰债券证券投资基金以2005年7月14日为转变基准日转变成为景顺长城货币市场证券投资基金。本基金自2010年4月30日起实行基金份额分级。

动力平衡基金的净值表现

1、基金份额净值增长率及其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)
2003年10月24日－2003年12月31日	3.89%	0.35%	0.75%	0.01%	3.14%	0.34%
2004年	6.85%	0.68%	4.03%	0.01%	2.82%	0.67%
2005年	0.31%	0.62%	4.29%	0.02%	−3.98%	0.60%
2006年	120.70%	1.16%	4.30%	0.01%	116.40%	1.15%
2007年	93.99%	1.70%	5.63%	0.02%	88.36%	1.68%
2008年	−43.74%	1.65%	6.53%	0.02%	−50.27%	1.63%
2009年	41.27%	1.12%	3.51%	0.01%	37.76%	1.11%
2010年	−7.25%	1.19%	0.45%	0.76%	−7.70%	0.43%
2011年	−22.69%	0.99%	−10.71%	0.65%	−11.98%	0.34%
2012年	5.66%	1.00%	5.44%	0.64%	0.22%	0.36%
2013年	10.55%	1.24%	−4.23%	0.70%	14.28%	0.54%
2014年	8.55%	1.00%	29.83%	0.61%	−21.28%	0.39%
2015年	20.27%	2.41%	8.49%	1.24%	11.78%	1.17%
2016年	−0.32%	1.34%	−4.65%	0.71%	4.33%	0.63%
2017年	36.53%	0.68%	9.94%	0.32%	26.59%	0.36%
2018年1月1日至2018年6月30日	−3.46%	1.27%	−4.40%	0.57%	0.94%	0.70%
2018年1月1日至2018年9月30日	−12.38%	1.30%	−4.81%	0.61%	−7.57%	0.69%
2003年10月24日－2018年9月30日	394.08%	1.28%	69.06%	0.56%	325.02%	0.72%

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



注：本基金的资产配置比例为：股票投资的比例为基金资产净值的20%至80%；债券投资的比例为基金资产净值的20%至80%。按照本系列基金基金合同的规定，本基金自2003年10月24日合同生效日起至2004年1月23日为建仓期。本基金于2007年9月10日实施分红，此后基金资产规模持续增长，根据基金部函[2007]91号《关于实施基金份额拆分后调整基金建仓期有关问题的复函》的有关规定，本基金证券投资比例的调整期限延长至2007年10月9日止。建仓期结束时，本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。

十五、基金费用概览

本系列基金下各基金发生的费用单独计算和计提，分别支付。本章中第（一）节至第（四）节的内容适用于优选混合型基金和动力平衡基金，第（二）节第3点、第（三）节至第（六）节的内容适用于货币市场基金。

（一）与基金运作有关的费用

1、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）基金证券交易费用；
（4）基金的信息披露费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
（7）上述费用由基金管理人按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。
（8）本系列基金共同承担的基金费用按照1/n的比例由各基金分摊。（n ＝ 本系列基金所包含的基金的数目。）除各基金个别清算外、单独公告及其他由管理人依公允的原则决定经托管人认可的只涉及某基金所产生的费用由该基金独自承担外，其他基金费用均为本款所称之本系列基金共同承担的费用。

2、与基金运作有关的费用的费率、计提方法、计提标准、收取方式和使用方式

（1）基金管理人的管理费

基金管理人的管理费，在通常情况下，按前一日的各基金资产净值乘以相应的管理年费，计算方法如下：

H=E×年管理费率÷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。

各基金管理费率如下：

基金名称	管理年费率
优选混合型基金	1.5%
动力平衡基金	1.5%

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从各基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

基金托管人的托管费，在通常情况下，按前一日的各基金资产净值乘以相应的托管年费，计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数
H：为每日应支付的基金托管费；
E：为前一日的基金资产净值。

各基金托管费率如下：

基金名称	托管年费率
优选混合型基金	0.25%
动力平衡基金	0.25%

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

（3）基金首次发行中所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金财产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关规定列支；若本系列基金发行失败，发行费用由基金管理人承担。基金合同生效后的各项费用按有关规定列支。

（4）上述1、基金费用第3－7项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

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本系列基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会通过。

（二）与基金销售有关的费用

1、基金申购费用

（1）基金申购可适用以下费率：

基金名称	申购费率
优选混合型基金	M＜50万 1.5% 50万≤M＜100万 1.2% 100万≤M＜200万 1.0% 200万≤M＜500万 0.6% M≥500万 按笔收取，500元/笔
动力平衡基金	M＜50万 1.5% 50万≤M＜100万 1.2% 100万≤M＜200万 1.0% 200万≤M＜500万 0.6% M≥500万 按笔收取，500元/笔

M表示申购金额。

（2）计算公式

本系列基金采用金额申购方法，计算公式如下：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：
净申购金额=申购金额/（1+申购费率）；
申购费用=申购金额–净申购金额；
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值。

（3）例：某投资者投资5,000元申购动力平衡基金，申购费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.1283元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=5000/（1+1.5%）=4926.11元；
申购费用=5000–4926.11=73.89元；
申购份额=4926.11/1.1283=4365.95份

2、赎回费

（1）适用费率：

基金名称	赎回费率
优选混合型基金	7天以内 1.5% 7天以上（含）－1年以内 0.4% 1年以上（含）－2年 0.25% 2年以上（含） 0
动力平衡基金	7天以内 1.5% 7天以上（含）－1年以内 0.4% 1年以上（含）－2年 0.25% 2年以上（含） 0

注：就赎回费而言，1年指365天，2年指730天。

（2）计算公式

赎回总额=赎回份额×赎回当日基金份额净值
赎回费用=赎回总额×赎回费率

（3）本系列基金赎回费75%归注册登记费用，25%归基金所有，作为对其他持有人的补偿。

（4）例：某投资者持有优选混合型基金10,000份基金份额，赎回费率为0.4%，假设赎回当日基金份额净值是1.1489元，则可得到的赎回金额为：

赎回总额 ＝ 10,000×1.1489 ＝ 11,489元
赎回费用 ＝ 11,489×0.4% ＝ 45.96元
赎回金额 ＝ 11,489–45.96 ＝ 11,443.04元

3、转换费用

本系列基金的转换交易包括了基金转出和基金转入，其中：

①基金转出时赎回费的计算：

由优选混合型基金或动力平衡基金转出时：

转出总额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值

由货币基金转出时：

转出总额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值+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

转出净额＝转出总额－赎回费用

②基金转入时申购补差费的计算：

净转入金额＝转出净额－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

例：投资者申请将持有的优选混合型基金10,000份转换为景顺长城内需增长开放式证券投资基金，假设转换当日优选混合型基金的基金份额净值为1.148元，投资者持有该基金18个月，对应赎回费为0.25%，申购费为1.5%，内需增长基金的基金份额净值为1.163元，申购费为1.5%，则投资者转换后可得到的内需增长基金份额为：

转出总额＝10,000×1.148＝11,480元
赎回费用＝11,480×0.25%＝28.70元
转出净额＝11,480－28.7＝ 11,451.3元
转出净额在转入基金中对应的净申购金额=11,451.3/1.015=11,282.07元
转出净额在转入基金中对应的申购费用=11,451.3－11,282.07=169.23元
转出净额在转出基金中对应的净申购金额=11,451.3/1.015=11,282.07元
转出净额在转出基金中对应的申购费用=11,451.3－11,282.07=169.23元
净转入金额＝11,451.3－MAX【169.23－169.23，0】=11,451.3元
转入份额＝11,451.3 / 1.163＝9,846.34份

（三）其他费用

本系列基金运作和销售过程中发生的其他费用，以及因政与本系列基金有关的其他费用，将依照国家法律法规的规定，予以收取和使用。

（四）本系列基金运作过程中的各类纳税主体，依照国家法律法规的规定，履行纳税义务。

（五）货币市场基金费用的种类
1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、销售服务费；
4、基金证券交易费用；
5、基金的信息披露费用；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
8、按照国家有关规定可以列入的其它费用。

（六）货币市场基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理费

货币市场基金管理费年费率为0.33%，在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的管理年费率，计算方法如下：

H=E×年管理费率÷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。

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管费

货币市场基金托管费年费率为0.10%，在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的托管年费率，计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数
H：为每日应支付的基金托管费；
E：为前一日的基金资产净值。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

3、销售服务费

货币市场基金的销售服务费用于该基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人代收并分配给相关服务机构。在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的销售服务年费率，计算方法如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数
H：为每日应支付的销售服务费；
E：为前一日的基金资产净值。

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

A级基金份额销售服务费率为0.25%、B级基金份额销售服务费率为0.01%。基金管理人可以根据市场状况和本基金的具体情况调低货币市场基金的销售服务费率。基金管理人必须在开始调整之日的3个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

4、基金首次发行中所发生的律师费、会计师费及与基金有关的法定信息披露费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金财产中支付；若基金发行失败，发行费用由基金管理人承担。基金合同生效后的各项费用按有关规定列支。

5、上述（五）货币市场基金费用第4－8项费用，除上款规定的费用外，由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，从基金财产中支付。

十六、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本系列基金实施的投资管理活动，对基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在"三、基金管理人"部分，更新了法定代表人、董事会成员、高级管理人员、基金经理及投资决策委员会成员名单等的相关信息；

2、在"四、基金托管人"部分，更新了托管人相关情况信息；

3、在"五、相关服务机构"部分，更新了基金份额发售机构的相关信息；

4、在"七、基金的申购、赎回"部分，更新了基金定期定额投资计划的相关信息；

5、在"十、基金的投资"部分，更新了基金投资组合报告，数据截至2018年9月30日；

6、更新了"十二、基金的业绩"部分，数据截至2018年9月30日；

7、在"二十四、其他应披露事项"部分，更新了近期发布与本基金有关的公告目录，目录更新至2018年10月24日；

景顺长城基金管理有限公司
二〇一八年十二月八日

关于景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期：2018年12月8日

1. 公告基本信息

基金名称	景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金
基金简称	景顺长城景泰聚利纯债债券
基金主代码	006681
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月7日
基金管理人名称	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司
公告依据	《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》等相关法律法规以及《景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金基金合同》、《景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金招募说明书》

2. 基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号		中国证监会证监许可【2018】1891号
基金募集期间		自2018年11月30日 至2018年12月4日止
验资机构名称		普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
募集资金划入基金托管专户的日期		2018年12月6日
募集有效认购总户数（单位：户）		771
募集期间净认购金额（单位：元）		285,254,499.70
认购资金在募集期间产生的利息（单位：元）		22,383.52
募集份额（单位：份）	有效认购份额	285,254,499.70
	利息结转的份额	22,383.52
	合计	285,276,883.22
其中：募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额（单位：份）	0
	占基金总份额比例	0
	其他需要说明的事项	无
其中：募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额（单位：份）	0
	占基金总份额比例	0
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件		是
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期		2018年12月7日

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量为0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量为0。

2、按照有关法律规定，本次基金募集期间所发生的律师费、会计师费、信息披露费等费用由基金管理人承担，不从基金财产中列支。

3.其他需要提示的事项

销售机构受理投资人认购申请并不代表该申请一定成功，申请的成功与否须以本基金注册登记机构的确认结果为准。基金份额持有人可以在本基金基金合同生效之日起2个工作日之后，到销售机构的网点进行交易确认的查询，也可以通过本基金管理人的客户服务电话4008888606和网站www.igwfmc.com查询交易确认状况。

本基金的申购、赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间内开始办理。在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人在开始日前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒体上公告。

风险提示：本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，也不保证最低收益。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。