

# 景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金 2018 年第 2 号更新招募说明书摘要

## 重要提示

(一) 景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定募集,并经 2017 年 6 月 23 日中国证监会监督管理委员会证监许可【2017】1019 号文准予募集。基金基金合同于 2017 年 9 月 27 日正式生效。

(二) 基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会注册,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。

(三) 投资有风险,投资人认(申)购本基金时应认真阅读本招募说明书。

(四) 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。

(五) 基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

(六) 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,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。

(七) 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,获得基金投资收益,亦自行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: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,基金投资对象与投资策略引致的特定风险,等等。本基金以定期开放方式运作,在封闭期内,本基金不接受基金份额的申购和赎回,也不上市交易。因此,在封闭期内,基金份额持有人将面临因不能赎回或卖出基金份额而出现的流动性约束。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

(八) 本基金单一投资者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。

(九) 本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 9 月 27 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 6 月 30 日。本招募说明书中财务数据未经审计。

**基金管理人: 景顺长城基金管理有限公司**

**基金托管人: 中国农业银行股份有限公司**

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

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1座21层

设立日期：2003年6月12日

法定代表人：杨光裕

注册资本：1.3亿元人民币

批准设立文号：证监基金字[2003]76号

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第1座21层

电话：0755-82370388

客户服务电话：400 8888 606

传真：0755-22381339

联系人：杨皞阳

股东名称及出资比例：

| 序号 | 股东名称         | 出资比例 |
|----|--------------|------|
| 1  | 长城证券股份有限公司   | 49%  |
| 2  | 景顺资产管理有限公司   | 49%  |
| 3  | 开滦（集团）有限责任公司 | 1%   |
| 4  | 大连实德集团有限公司   | 1%   |
| 合计 |              | 100% |

### (二) 主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

康乐先生，代行董事长，董事，总经理，经济学硕士。曾先后担任中国人寿资产管理有限公司研究部研究员、组合管理部投资经理、国际业务部投资经理，景顺投资管理有限公司市场销售部经理、北京代表处首席代表，中国国际金融有限公司销售交易部副总经理。2011年7月加入本公司，现任公司董事兼总经理。

丁益女士，董事，经济学博士。曾担任中国人民大学财政金融学院讲师；华能国际电力股份有限公司证券融资部干部，证券融资部投资关系处副处长、处长，证券融资部副经理兼

投资关系处处长；中国人民保险公司投资管理部副总经理；中国人保资产管理有限公司党委委员、董事、总裁助理；华能资本常务副总经理（主持工作）、党组书记；华能资本总经理、党组书记。现任华能资本服务有限公司董事长、党组书记，长城证券股份有限公司董事长。

罗德城先生，董事，工商管理硕士。曾任大通银行信用分析师、花旗银行投资管理部副总裁、Capital House亚洲分公司的董事总经理。1992至1996年间出任香港投资基金公会管理委员会成员，并于1996至1997年间担任公会主席。1997至2000年间，担任香港联交所委员会成员，并在1997至2001年间担任香港证监会顾问委员会成员。现任景顺集团亚太区首席执行官。

李翔先生，董事，高级管理人员工商管理硕士。曾任长城证券股份有限公司人事部副总经理、人事监察部总经理、营业部总经理、公司营销总监、营销管理部总经理。现任长城证券股份有限公司副总裁、党委委员。

伍同明先生，独立董事，文学学士。香港会计师公会会员（HKICPA）、英国特许公认会计师（ACCA）、香港执业会计师（CPA）、加拿大公认管理会计师（CMA）。拥有超过二十年以上的会计、审核、管治税务的专业经验及知识，1972-1977受训于国际知名会计师事务所“毕马威会计师事务所”[KPMG]。现为“伍同明会计师行”所有者。

靳庆军先生，独立董事，法学硕士。曾担任中信律师事务所涉外专职律师，在香港马士打律师行、英国律师行Clyde & Co. 从事律师工作，1993年发起设立信达律师事务所，担任执行合伙人。现任金杜律师事务所合伙人。

闵路浩先生，独立董事，经济学硕士。曾担任中国人民银行金融管理公司科员、主任科员；中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行业监督管理委员会非银行金融机构监管部处长、副巡视员、巡视员；中国小额贷款公司协会会长；重庆富民银行行长。现担任北京中泰创汇股权投资基金管理有限公司总裁。

## 2、基金管理人监事会成员

阮惠仙女士，监事，会计学硕士。现任长城证券股份有限公司财务部总经理。

郭慧娜女士，监事，管理学硕士。曾任伦敦安永会计师事务所核数师，历任景顺投资管理有限公司项目主管、业务发展部副经理、企业发展部经理、亚太区监察总监。现任景顺投资管理有限公司亚太区首席行政官。

邵媛媛女士，监事，管理学硕士。曾任职于深圳市天健（信德）会计师事务所、福建兴业银行深圳分行计财部。现任景顺长城基金管理有限公司基金事务部总监。

杨波先生，监事，工商管理硕士。曾任职于长城证券经纪业务管理部。现任景顺长城基金管理有限公司交易管理部总监。

### 3、高级管理人员

康乐先生，代行董事长职务，简历同上。

康乐先生，总经理，简历同上。

毛从容女士，副总经理，经济学硕士。曾任职于交通银行深圳市分行国际业务部，担任长城证券金融研究所高级分析师、债券小组组长。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

黎海威先生，副总经理，经济学硕士。曾担任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，现任公司副总经理。

赵代中先生，副总经理，理学硕士。曾担任深圳发展银行北京分行金融同业部投资经理、宁夏嘉川集团项目部项目负责人、全国社会保障基金理事会境外投资部全球股票处处长、浙江大钧资产管理有限公司合伙人兼副总经理。2016年3月加入本公司，现任公司副总经理。

吴建军先生，副总经理，经济学硕士。曾担任海南汇通国际信托投资公司证券部副经理，长城证券股份有限公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

刘焕喜先生，副总经理，投资与金融系博士。曾担任武汉大学教师工作处副科长、武汉大学成人教育学院讲师，《证券时报》社编辑记者，长城证券研发中心研究员、总裁办副主任、行政部副总经理。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

杨皦阳先生，督察长，法学硕士。曾担任黑龙江省大庆市红岗区人民法院助理审判员，南方基金管理有限公司监察稽核部监察稽核经理、监察稽核高级经理、总监助理。2008年10月加入本公司，现任公司督察长。

### 4、本基金现任基金经理简历

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。本基金现任基金经理如下：

成念良先生，管理学硕士。曾担任大公国际资信评级有限公司评级部高级信用分析师，平安大华基金投研部信用研究员、专户业务部投资经理。2015年9月加入本公司，自2015年12月起担任固定收益部基金经理。具有9年证券、基金行业从业经验。

万梦女士，工学硕士。曾任职于壳牌（中国）有限公司。2011年9月加入本公司，先后担任研究部行业研究员、固定收益部研究员和基金经理助理职务；自2015年7月起担任基金经理。具有7年证券、基金行业从业经验。

#### 5、本基金现任基金经理曾管理的基金名称及管理时间

本基金现任基金经理成念良先生曾于2015年12月至2017年12月管理景顺长城交易型货币市场基金；2016年12月至2018年5月管理景顺长城顺益回报混合型证券投资基金；2017年5月至2017年11月管理景顺长城景盈汇利债券型证券投资基金。

本基金现任基金经理万梦女士曾于2016年2月至2017年2月管理景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金。

#### 6、本基金现任基金经理兼任其他基金基金经理的情况

本基金现任基金经理成念良先生兼任景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金基金经理、景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金和景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金基金经理。

本基金现任基金经理万梦女士兼任景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金基金经理。

#### 7、本基金历任基金经理姓名及管理时间

无。

#### 8、投资决策委员会委员名单

本公司的投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、各投资总监、研究总监、基金经理代表等组成。

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下：

康乐先生，总经理；

毛从容女士，副总经理；

黎海威先生，副总经理兼量化及指数投资部投资总监；

余广先生，总经理助理兼股票投资部投资总监；

刘彦春先生，总经理助理兼研究部总监；

陈文鹏先生，固定收益部投资总监。

9、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISAIE3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业

银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近240名,其中具有高级职称的专家30余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到2018年06月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共425只。

### (二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

#### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

#### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

#### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

**三、相关服务机构**

**(一) 基金份额发售机构**

1、直销机构

名称：景顺长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市中心四路1号嘉里建设广场第1座21层

办公地址：深圳市中心四路1号嘉里建设广场第1座21层

法定代表人：杨光裕

批准设立文号：证监基金字[2003]76号

电话：0755-82370388-1663

传真：0755-22381325

联系人：周婷

客户服务电话：0755-82370688、4008888606

网址：www.igwfm.com

注：直销机构包括本公司深圳直销中心及直销网上交易系统/电子交易直销前置式自助前台（具体以本公司官网列示为准）

2、代销机构

| 序号 | 全称           | 销售机构信息                                       |
|----|--------------|--|
| 1  | 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<br>办公地址：北京市东城区建国门内大街69号 |



|   |                |   |
|---|----------------|---|
|   |                | <p>法定代表人：周慕冰<br/>                 联系人：张伟<br/>                 电话：010-85109219<br/>                 传真：010-85109219<br/>                 客户服务电话：95599<br/>                 网址：www.abchina.com</p>  |
| 2 | 中国银行股份有限公司     | <p>注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街1号<br/>                 法定代表人：陈四清<br/>                 联系人：宋亚平<br/>                 客户服务电话：95566（全国）<br/>                 网址：www.boc.cn</p>   |
| 3 | 中国工商银行股份有限公司   | <p>注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街55号<br/>                 法定代表人：易会满<br/>                 客户服务电话：95588（全国）<br/>                 网址：www.icbc.com.cn</p>  |
| 4 | 交通银行股份有限公司     | <p>住所（办公）地址：上海市浦东新区银城中路188号<br/>                 法定代表人：彭纯<br/>                 联系人：王菁<br/>                 电话：021-58781234-1601<br/>                 传真：021-58408483<br/>                 客户服务电话：95559<br/>                 网址：www.bankcomm.com</p>                                     |
| 5 | 招商银行股份有限公司     | <p>注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道7088号<br/>                 法定代表人：李建红<br/>                 联系人：邓炯鹏<br/>                 客户服务电话：95555<br/>                 网址：www.cmbchina.com</p>  |
| 6 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | <p>注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号<br/>                 办公地址：上海市中山东一路12号<br/>                 法定代表人：吉晓辉<br/>                 联系人：高天、于慧<br/>                 电话：（021）61618888<br/>                 传真：（021）63604199<br/>                 客户服务热线：95528<br/>                 公司网站：www.spdb.com.cn</p> |

|    |              |  |
|----|--------------|--|
| 7  | 兴业银行股份有限公司   | 注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦<br>法定代表人：高建平<br>联系人：陈丹<br>电话：(0591)87844211<br>客户服务电话：95561<br>网址：www.cib.com.cn   |
| 8  | 中国民生银行股份有限公司 | 注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号<br>法定代表人：洪崎<br>联系人：穆婷<br>联系电话：010-58560666<br>传真：010-57092611<br>客户服务热线：95568<br>网址：www.cmbc.com.cn                                |
| 9  | 平安银行股份有限公司   | 注册（办公）地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦<br>法定代表人：孙建一<br>联系人：张莉<br>电话：021-38637673<br>传真：021-50979507<br>客户服务电话：95511—3<br>网址：www.bank.pingan.com                     |
| 10 | 渤海银行股份有限公司   | 注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号<br>办公地址：天津市河东区海河东路 218 号渤海银行大厦<br>法定代表人：李伏安<br>联系人：王宏<br>联系电话：022-58316666<br>传真：022-58316259<br>客户服务热线：95541<br>网址：www.cbhb.com.cn |
| 11 | 包商银行股份有限公司   | 注册（办公）地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号<br>办公地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号<br>法定代表人：李镇西<br>联系人：张建鑫<br>电话：010-64816038<br>传真：010-84596546<br>客服电话：95352<br>网站：www.bsb.com.cn              |

|    |                  |  |
|----|------------------|--|
| 12 | 南京银行股份有限公司       | 注册（办公）地址：南京市中山路288号<br>法定代表人：林复<br>联系人：李冰洁<br>电话：025-86775317<br>传真：025-86775376<br>客户服务电话：40088-96400(全国)、96400（江苏）<br>网址：www.njcb.com.cn                                   |
| 13 | 苏州银行股份有限公司       | 注册（办公）地址：苏州工业园区钟园路728号<br>法定代表人：王兰凤<br>联系人：葛晓亮<br>传真：0512-69868370<br>客户服务电话：0512-96067<br>网址：www.suzhoubank.com   |
| 14 | 上海农村商业银行股份有限公司   | 注册(办公)地址：上海市黄浦区山东二路70号<br>法定代表人：冀光恒<br>客户服务电话：021-962999、4006962999<br>网址：www.srcb.com   |
| 15 | 中原银行股份有限公司       | 注册地址：河南省郑州市郑东新区CBD商务外环路23号中科金座大厦<br>办公地址：河南省郑州市郑东新区CBD商务外环路23号中科金座大厦<br>法定代表人：窦荣兴<br>联系人：牛映雪<br>电话：0371-85517710<br>传真：0371-85519869<br>客户服务电话：96688<br>网址：www.zybank.com.cn |
| 16 | 江苏江南农村商业银行股份有限公司 | 注册（办公）地址：常州和平中路413号<br>法定代表人：陆向阳<br>联系人：蒋姣<br>电话：0519-80585939<br>传真：0519-89995017<br>客户服务电话：96005<br>网址：www.jnbank.com.cn   |

|    |              |   |
|----|--------------|---|
| 17 | 恒丰银行股份有限公司   | 注册（办公）地址：中国烟台市芝罘区南大街 248 号<br>法定代表人：蔡国华<br>联系人：李胜贤<br>电话：021-63890179<br>传真：021-63890196<br>客户服务电话：95395<br>网址：www.hfbank.com.cn  |
| 18 | 四川天府银行股份有限公司 | 注册地址：四川省南充市涪江路 1 号<br>办公地址：四川省成都市锦江区下东大街 258 号<br>法定代表人：邢敏<br>联系人：樊海波<br>电话：028-67676033<br>客户服务电话：4001696869<br>网址：www.tf.cn   |
| 19 | 长城证券股份有限公司   | 注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层<br>法定代表人：丁益<br>办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层<br>客户服务电话：4006666888<br>联系人：金夏<br>联系电话：0755-83516289<br>邮箱：jinxia@cgws.com<br>网址：www.cgws.com |
| 20 | 中信建投证券股份有限公司 | 注册（办公）地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼<br>法定代表人：王常青<br>联系人：许梦园<br>电话：（010）85156398<br>传真：（010）65182261<br>客户服务电话：4008888108/95587<br>网址：www.csc108.com  |
| 21 | 申万宏源证券有限公司   | 注册（办公）地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层<br>法定代表人：李梅<br>联系人：曹晔<br>电话：021-33389888<br>传真：021-33388224<br>客户服务电话：95523 或   |

|    |              |   |
|----|--------------|---|
|    |              | 4008895523<br>网址: <a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a>  |
| 22 | 申万宏源西部证券有限公司 | 注册(办公)地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室<br>法定代表人: 李季<br>联系人: 王君<br>电话: 0991-7885083<br>传真: 0991-2310927<br>客户服务电话: 400-800-0562<br>网址: <a href="http://www.hysec.com">www.hysec.com</a> |
| 23 | 光大证券股份有限公司   | 注册(办公)地址: 上海市静安区新闸路1508号<br>法定代表人: 周健男<br>联系人: 郁疆<br>电话: 021-22169999<br>传真: 021-22169134<br>客户服务电话: 95525、4008888788、10108998<br>网址: <a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a>          |
| 24 | 海通证券股份有限公司   | 注册(办公)地址: 上海市广东路689号<br>法定代表人: 周杰<br>联系人: 李笑鸣<br>电话: 021-23219000<br>传真: 021-23219100<br>客服电话: 95553<br>网址: <a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a>                                    |
| 25 | 平安证券股份有限公司   | 注册(办公)地址: 深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层<br>法人代表: 谢永林<br>联系人: 周一涵<br>电话: 021-38637436<br>传真: 021-33830395<br>客户服务电话: 95511-8<br>网址: <a href="http://stock.pingan.com">stock.pingan.com</a>         |

|    |              |   |
|----|--------------|---|
| 26 | 中国国际金融股份有限公司 | 注册（办公）地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层<br>法定代表人：丁学东<br>联系人：杨涵宇<br>电话：010-65051166<br>客户服务电话：400 910 1166<br>网址：www.cicc.com.cn   |
| 27 | 方正证券股份有限公司   | 注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层<br>办公地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼2701-3717<br>法定代表人：高利<br>联系人：胡创<br>电话：010-59355941<br>传真：010-56437013<br>客服热线：95571<br>网址：www.foundersc.com |
| 28 | 天相投资顾问有限公司   | 注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701<br>办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层<br>法定代表人：林义相<br>联系人：尹伶<br>电话：010-66045529<br>传真：010-66045518<br>客服热线：010-66045678<br>网址：www.txsec.com                  |
| 29 | 西部证券股份有限公司   | 注册（办公）地址：西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层<br>法定代表人：刘建武<br>联系人：梁承华<br>电话：029-87406168<br>传真：029-87406710<br>客服热线：95582<br>网址：www.westsecu.com.cn   |
| 30 | 华福证券有限责任公司   | 注册（办公）地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层<br>法定代表人：黄金琳<br>联系人：张腾<br>电话：0591-87383623<br>传真：0591-87383610<br>客户服务电话：96326（福建省外请加拨0591）  |

|    |            |   |
|----|------------|---|
|    |            | 网址: <a href="http://www.hfzq.com.cn">www.hfzq.com.cn</a>  |
| 31 | 信达证券股份有限公司 | 注册(办公)地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼<br>法定代表人: 张志刚<br>联系人: 唐静<br>电话: 010-63081000<br>传真: 010-63080978<br>客服热线: 95321<br>网址: <a href="http://www.cindasc.com">www.cindasc.com</a>                             |
| 32 | 华龙证券股份有限公司 | 注册(办公)地址: 兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心<br>法定代表人: 李晓安<br>联系人: 李昕田<br>电话: 0931-4890208<br>客户服务电话: 0931-96668, 4006898888<br>网址: <a href="http://www.hlzqgs.com">www.hlzqgs.com</a>                            |
| 33 | 国金证券股份有限公司 | 注册地址: 成都市东城根上街95号<br>办公地址: 成都市东城根上街95号<br>法定代表人: 冉云<br>联系人: 刘婧漪、贾鹏<br>电话: 028-86690057、02886690058<br>传真: 028-86690126<br>客服电话: 95310<br>公司网站: <a href="http://www.gjzq.com.cn">www.gjzq.com.cn</a> |
| 34 | 中航证券有限公司   | 注册(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<br>法定代表人: 杜航<br>联系人: 戴蕾<br>联系电话: 0791-86768681<br>客户服务电话: 400-8866-567<br>公司网址: <a href="http://www.avicsec.com">www.avicsec.com</a>                        |

|    |                |  |
|----|----------------|--|
| 35 | 中信证券股份有限公司     | 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座<br>办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦<br>法定代表人：张佑君<br>联系人：王一通<br>电话：010-60838888<br>传真：010-60833739<br>客服电话：95548<br>网址：www.cs.ecitic.com |
| 36 | 长江证券股份有限公司     | 注册（办公）地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦<br>法定代表人：杨泽柱<br>联系人：奚博宇<br>电话：027-65799999<br>传真：027-85481900<br>客户服务电话：95579 或 4008-888-999<br>网址：www.95579.com                        |
| 37 | 中泰证券股份有限公司     | 注册（办公）地址：济南市市中区经七路86号<br>法定代表人：李玮<br>联系人：许曼华<br>电话：021-20315290<br>传真：021-20315125<br>客户服务电话：95538<br>网址：www.zts.com.cn  |
| 38 | 中信证券（山东）有限责任公司 | 注册（办公）地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001<br>法定代表人：姜晓林<br>联系人：刘晓明<br>联系电话：0531-89606165<br>传真：0532-85022605<br>客户服务电话：95548<br>网址：www.zxwt.com.cn                            |
| 39 | 西南证券股份有限公司     | 注册（办公）地址：重庆市江北区桥北苑8号<br>法定代表人：吴坚<br>联系人：张煜<br>电话：023-63786141<br>传真：023-63786212<br>客服电话：400 809 6096<br>公司网站：www.swsc.com.cn                                    |



|    |              |  |
|----|--------------|--|
| 40 | 东海证券股份有限公司   | 注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层<br>办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦<br>法定代表人：赵俊<br>电话：021-20333333<br>传真：021-50498825<br>联系人：王一彦<br>客服电话：95531；400-8888-588<br>网址：www.longone.com.cn  |
| 41 | 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<br>法定代表人：刘学民<br>联系人：毛诗莉<br>电话：0755-23838750<br>传真：0755-23838750<br>客服电话：400-888-1888<br>网址：www.fcsc.com                                     |
| 42 | 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<br>法定代表人：孟建军<br>联系人：匡婷<br>电话：028-86583053<br>传真：028-86583053<br>客户服务电话：028-95105118<br>公司网址：http://www.cczq.com                       |
| 43 | 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<br>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<br>法定代表人：余磊<br>联系人：崔成<br>电话：027-87610052<br>传真：027-87618863<br>客户服务电话：4008005000<br>网址：www.tfzq.com |

|    |              |  |
|----|--------------|--|
| 44 | 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<br>法定代表人：张皓<br>联系人：洪诚<br>电话：0755-23953913<br>传真：0755-83217421<br>客户服务电话：400-990-8826<br>网址：www.citicsf.com                      |
| 45 | 上海证券有限责任公司   | 注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼<br>办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼<br>法定代表人：李俊杰<br>联系人：邵珍珍<br>电话：021-53686888<br>传真：021-53686100-7008，021-53686200-7008<br>客户服务热线：4008918918                           |
| 46 | 开源证券股份有限公司   | 注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层<br>办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层<br>法定代表人：李刚<br>联系人：黄芳<br>电话：029-63387256<br>传真：029-81887256<br>客户服务电话：400-860-8866 或 95325<br>网址：www.kysec.cn                 |
| 47 | 中国民族证券有限责任公司 | 注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼<br>办公地址：北京市朝阳区五北四环中路盘古大观A座40—43F<br>法定代表人：何亚刚<br>联系人：齐冬妮<br>电话：010-59355807/13811475559<br>传真：010-56437013<br>客户服务电话：4008895618<br>网址：http://www.e5618.com |

|    |                |  |
|----|----------------|--|
| 48 | 上海华信证券有限责任公司   | 注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼<br>办公地址：上海市黄浦区南京西路399号明天广场22楼<br>法定代表人：陈灿辉<br>联系人：徐璐<br>电话：021-63898952<br>传真：021-68776977 转 8952<br>客户服务电话：4008205999<br>网址：www.shhxzq.com                        |
| 49 | 华鑫证券有限责任公司     | 注册（办公）地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元<br>法定代表人：俞洋<br>联系人：朱泽乾<br>电话：021-54967367<br>传真：021-54967032<br>客户服务电话：95323, 4001099918<br>（全国）021-32109999;<br>029-68918888<br>网址：www.cfsc.com.cn |
| 50 | 广州证券股份有限公司     | 注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层<br>办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层<br>法定代表人：胡伏云<br>联系人：梁微<br>电话：020-88836999<br>传真：020-88836984<br>客户服务电话：95396<br>网址：www.gzs.com.cn                     |
| 51 | 深圳众禄基金销售股份有限公司 | 注册（办公）地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼<br>法定代表人：薛峰<br>联系人：童彩平<br>电话：0755-33227950<br>传真：0755-33227951<br>客户服务电话：4006-788-887<br>网址：众禄基金网 www.zlfund.cn<br>基金买卖网 www.jjmmw.com                            |

|    |                  |   |
|----|------------------|---|
| 52 | 蚂蚁（杭州）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<br>办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F<br>法定代表人：陈柏青<br>联系人：韩爱彬<br>电话：021-60897840<br>传真：0571-26697013<br>客户服务电话：4000-766-123<br>网址：www.fund123.cn |
| 53 | 诺亚正行基金销售有限公司     | 注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室<br>办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋<br>法定代表人：汪静波<br>联系人：方成<br>电话：021-38602377<br>传真：021-38509777<br>客户服务电话：400-821-5399<br>网址：www.noah-fund.com          |
| 54 | 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<br>办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层<br>法定代表人：张跃伟<br>联系人：单丙焯<br>电话：021-20691832<br>传真：021-20691861<br>客服电话：400-820-2899<br>公司网站：www.erichfund.com           |
| 55 | 上海好买基金销售有限公司     | 注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼4494<br>办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼<br>法定代表人：杨文斌<br>联系人：张茹<br>电话：021-58870011<br>传真：021-68596916<br>客户服务电话：400 700 9665<br>网址：www.ehowbuy.com       |

|    |                |  |
|----|----------------|--|
| 56 | 北京展恒基金销售股份有限公司 | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号<br>办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6层<br>法定代表人：闫振杰<br>联系人：李晓芳<br>联系电话：010-59601366 转 7167<br>客服电话：400-818-8000<br>公司网站：www.myfund.com                              |
| 57 | 和讯信息科技有限公司     | 注册（办公）地址：北京市朝外大街22号泛利大厦10层<br>法定代表人：王莉<br>联系人：习甜<br>联系电话：010-85650920<br>传真号码：010-85657357<br>全国统一客服热线：400-920-0022/<br>021-20835588<br>公司网址：licaik.hexun.com                    |
| 58 | 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<br>办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座（北楼）25层<br>法定代表人：其实<br>联系人：潘世友<br>电话：021-54509977-8400<br>传真：021-54509953<br>客服电话：400-1818-188<br>网址：http://www.1234567.com.cn |
| 59 | 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<br>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<br>法定代表人：凌顺平<br>联系人：杨翼<br>联系电话：0571-88911818-8565<br>传真：0571-86800423<br>客服电话：4008-773-772<br>网址：www.5ifund.com         |

|    |                  |  |
|----|------------------|--|
| 60 | 众升财富（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室<br>办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08<br>法定代表人：李招弟<br>联系人：高晓芳<br>电话：010-59393923<br>传真：010-64788105<br>客户服务电话：400-059-8888<br>网址：www.zscffund.com       |
| 61 | 宜信普泽（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809<br>办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809 室<br>法定代表人：沈伟桦<br>联系人：王巨明<br>电话：010-52855713<br>传真：010-85894285<br>客户服务电话：400-609-9200<br>网址：www.yixinfund.com |
| 62 | 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<br>办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室<br>法定代表人：罗细安<br>联系人：孙晋峰<br>电话：010-67000988<br>传真：010-67000988-6000<br>客户服务电话：400-001-8811<br>网址：www.zcvc.com.cn    |
| 63 | 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 号厦门第一广场西座 1501-1504 室<br>法定代表人：陈洪生<br>联系人：梁云波<br>联系电话：0592-3122757<br>客服电话：400-9180808<br>公司网站：www.xds.com.cn   |

|    |                  |   |
|----|------------------|---|
| 64 | 北京晟视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<br>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<br>法定代表人：蒋煜<br>联系人：徐长征、林凌<br>电话：010-58170943，<br>010-58170918<br>传真：010-58170800<br>客户服务电话：400-818-8866<br>网址：www.shengshiview.com |
| 65 | 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<br>法定代表人：赵学军<br>联系人：景琪<br>电话：021-20289890<br>传真：010-85097308<br>客户服务电话：400-021-8850<br>网址：www.harvestwm.cn  |
| 66 | 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#<br>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 7 层<br>法定代表人：马勇<br>电话：0755-88394666<br>传真：0755-88394677<br>客户服务电话：400-166-1188<br>网址：http://8.jrj.com.cn/                    |
| 67 | 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<br>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<br>法定代表人：吴雪秀<br>联系人：段京璐<br>电话：010-88312877<br>传真：010-88312885<br>客户服务电话：400-001-1566<br>网址：www.yilucaifu.com                 |

|    |                |  |
|----|----------------|--|
| 68 | 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<br>宏达北路10号五层5122室<br>办公地址：北京市朝阳区东三环北<br>路甲19号SOHO嘉盛中心30层<br>3001室<br>法定代表人：周斌<br>电话：010-59313555<br>传真：010-53509643<br>客户服务电话：400-8980-618<br>网址：www.chtwm.com                 |
| 69 | 北京钱景基金销售有限公司   | 注册（办公）地址：北京市海淀区<br>丹棱街6号1幢9层1008-1012<br>法定代表人：赵荣春<br>联系人：陈剑炜<br>电话：010-57418813<br>传真：010-57569671<br>客户服务电话：400-875-9885<br>网址：www.qianjing.com  |
| 70 | 深圳腾元基金销售有限公司   | 注册地址：深圳市福田区金田路<br>2028号卓越世纪中心1号楼1806<br>单元<br>办公地址：深圳市福田区深南中路<br>4026号田面城市大厦18A<br>法定代表人：曾革<br>联系人：叶健<br>电话：0755-33376853<br>传真：0755-33065516<br>客户服务电话：400-990-8600<br>网址：www.tenyuanfund.com |
| 71 | 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<br>31号5号楼215A<br>办公地址：北京市西城区民白纸坊<br>东街2号经济日报社综合楼A座<br>712室<br>法定代表人：梁蓉<br>联系人：魏素清<br>电话：010-66154828<br>传真：010-63583991<br>客户服务电话：400-6262-1818<br>网址：www.5irich.com           |



|    |                  |   |
|----|------------------|---|
| 72 | 上海联泰资产管理有限公司     | 注册地址：上海自由贸易区富特北路 277 号 3 层 310 室<br>办公地址：上海市长宁区金钟路 658 号 2 号楼 B 座 6 楼<br>法定代表人：燕斌<br>联系人：凌秋艳<br>电话：13636316950<br>传真：021-62990063<br>客户服务电话：400-046-6788<br>网址：www.66zichan.com     |
| 73 | 上海汇付基金销售有限公司     | 注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室<br>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<br>法定代表人：张晶<br>联系人：周丹<br>电话：021-33323999<br>传真：021-33323993<br>客户服务电话：400-820-2819<br>手机客户端：天天盈基金               |
| 74 | 上海利得基金销售有限公司     | 注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室<br>办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼<br>法定代表人：李兴春<br>联系人：徐鹏<br>电话：021-50583533<br>传真：021-50583633<br>客户服务电话：400-921-7755<br>公司网址：www.leadfund.com.cn |
| 75 | 北京新浪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<br>法定代表人：张欢行<br>联系人：李昭琛<br>电话：010-82244185<br>客户服务电话：010-62675369<br>网址：http://www.xincai.com/  |
| 76 | 泰诚财富基金销售（大连）有限公司 | 注册（办公）地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号<br>法定代表人：林卓<br>联系人：薛长平<br>电话：0411-88891212<br>传真：0411-84396536<br>客户服务电话：4006411999  |

|    |               |   |
|----|---------------|---|
|    |               | 网址: <a href="http://www.taichengcaifu.com">www.taichengcaifu.com</a>  |
| 77 | 上海陆金所基金销售有限公司 | 注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元<br>办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号<br>法定代表人: 王之光<br>联系人: 宁博宇<br>电话: 021-20665952<br>传真: 021-22066653<br>客户服务电话: 4008219031<br>网址: <a href="http://www.lufunds.com">www.lufunds.com</a>                   |
| 78 | 深圳富济基金销售有限公司  | 注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室<br>办公地址: 深圳市南山区高新技术产业园南七道惠恒集团二期 418 室<br>法定代表人: 齐小贺<br>联系人: 马力佳<br>电话: 0755-83999907-815<br>传真: 0755-83999926<br>客户服务电话: 0755-83999907<br>网址: <a href="http://www.jinqianwo.cn">www.jinqianwo.cn</a> |
| 79 | 北京虹点基金销售有限公司  | 注册地址: 北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603<br>办公地址: 北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层<br>法定代表人: 郑毓栋<br>联系人: 姜颖<br>电话: 010-56409010<br>客户服务电话: 400-068-1176<br>网址: <a href="http://www.hongdianfund.com">www.hongdianfund.com</a>                         |
| 80 | 珠海盈米财富管理有限公司  | 注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491<br>办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203<br>法定代表人: 肖雯<br>联系人: 黄敏嫦<br>电话: 020-89629099   |

|    |                  |  |
|----|------------------|--|
|    |                  | <p>传真：020-89629011<br/>                 客户服务电话：020-89629066<br/>                 网址：www.yingmi.cn</p>  |
| 81 | 大泰金石基金销售有限公司     | <p>注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室<br/>                 办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼<br/>                 法定代表人：袁顾明<br/>                 联系人：何庭宇<br/>                 电话：13917225742<br/>                 传真：021-22268089<br/>                 客户服务电话：400-928-2266/021-22267995<br/>                 网址：www.dtfunds.com</p>                |
| 82 | 中证金牛（北京）投资咨询有限公司 | <p>注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室<br/>                 办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层<br/>                 法定代表人：钱昊旻<br/>                 联系人：孙雯<br/>                 电话：010-59336519<br/>                 传真：010-59336500<br/>                 客户服务电话：4008-909-998<br/>                 网址：www.jnlc.com</p>                                       |
| 83 | 奕丰基金销售有限公司       | <p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）<br/>                 办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室<br/>                 法定代表人：TAN YIK KUAN<br/>                 联系人：叶健<br/>                 电话：0755-89460500<br/>                 传真：0755-21674453<br/>                 客户服务电话：400-684-0500<br/>                 网址：www.ifastps.com.cn</p> |

|    |                |  |
|----|----------------|--|
| 84 | 和耕传承基金销售有限公司   | 注册(办公)地址: 河南省郑州市郑东新区心怡路西广场路南升龙广场 2 号楼 701<br>法定代表人: 李淑慧<br>联系人: 裴小龙<br>电话: 0371-55213196<br>传真: 0371-85518397<br>客户服务电话: 400-0555-671<br>网址: <a href="http://www.hgccpb.com">www.hgccpb.com</a>  |
| 85 | 上海凯石财富基金销售有限公司 | 注册地址: 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室<br>办公地址: 上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼<br>法定代表人: 陈继武<br>联系人: 李晓明<br>电话: 021-63333319<br>传真: 021-63332523<br>客户服务电话: 4006433389<br>网址: <a href="http://www.vstonewealth.com">www.vstonewealth.com</a>                           |
| 86 | 深圳市金斧子基金销售有限公司 | 注册地址: 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层<br>办公地址: 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 7 层<br>法人代表: 赖任军<br>联系人: 刘昕霞<br>电话: 0755-29330513<br>传真: 0755-26920530<br>客服电话: 400-930-0660<br>公司网址: <a href="http://www.jfzinv.com">www.jfzinv.com</a> |
| 87 | 武汉市伯嘉基金销售有限公司  | 注册(办公)地址: 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第 7 栋 23 层 1 号、4 号<br>法定代表人: 陶捷<br>联系人: 孔繁<br>电话: 18672739925<br>客户服务电话: 027-87006003<br>网址: <a href="http://www.buyfunds.cn">www.buyfunds.cn</a>   |

|    |                |   |
|----|----------------|---|
| 88 | 北京汇成基金销售有限公司   | 注册地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号<br>办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层<br>法定代表人：王伟刚<br>客服电话：400-619-9059<br>公司网址：<br><a href="http://www.hcjijin.com">www.hcjijin.com</a>  |
| 89 | 南京苏宁基金销售有限公司   | 注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号<br>法定代表人：钱燕飞<br>联系人：王锋<br>电话：025-66996699-887226<br>传真：025-66996699<br>客户服务电话：95177<br>网址： <a href="http://www.snjjjin.com">www.snjjjin.com</a>   |
| 90 | 上海大智慧基金销售有限公司  | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元<br>法定代表人：申健<br>联系人：印强明<br>电话：021-20219988<br>传真：021-20219988<br>客户服务电话：021-20292031<br>网址： <a href="https://www.wg.com.cn">https://www.wg.com.cn</a>                     |
| 91 | 北京广源达信基金销售有限公司 | 注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室<br>办公地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层<br>法定代表人：齐剑辉<br>联系人：王英俊<br>电话：010-57298634<br>客服电话：4006236060<br>传真：010-82055860<br>网址： <a href="http://www.niuniufund.com">www.niuniufund.com</a> |
| 92 | 上海中正达广基金销售有限公司 | 注册（办公）地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室<br>法定代表人：黄欣<br>联系人：戴珉微<br>电话：021-33768132<br>传真：021-33768132-802<br>客户服务电话：400-6767-523<br>网址： <a href="http://www.zhongzhengfund.com">www.zhongzhengfund.com</a>                    |

|    |                 |  |
|----|-----------------|--|
| 93 | 海银基金销售有限公司      | 注册（办公）地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元<br>法定代表人：刘惠<br>联系人：毛林<br>电话：021-80133597<br>传真：021-80133413<br>客户服务电话：400-808-1016<br>网址：www.fundhaiyin.com   |
| 94 | 上海万得基金销售有限公司    | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座<br>办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼<br>法定代表人：王廷富<br>联系人：姜吉灵<br>电话：021-5132 7185<br>传真：021-5071 0161<br>客户服务电话：400-821-0203   |
| 95 | 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司 | 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）<br>办公地址：深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A<br>法定代表人：高锋<br>联系人：廖苑兰<br>电话：0755-83655588<br>传真：0755-83655518<br>客户服务电话：4008048688<br>网址：www.keynesasset.com |
| 96 | 中民财富基金销售（上海）    | 注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元<br>办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层<br>法定代表人：弭洪军<br>联系人：茅旦青<br>电话：021-33355392<br>传真：021-63353736<br>客户服务电话：4008323291<br>网址：www.cmiwm.com                               |

|     |              |  |
|-----|--------------|--|
| 97  | 天津国美基金销售有限公司 | 注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室<br>办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层<br>法定代表人：丁东华<br>联系人：郭宝亮<br>电话：010-59287984<br>传真：010-59287825<br>客户服务电话：4001110889<br>网址：www.gomefund.com    |
| 98  | 北京蛋卷基金销售有限公司 | 注册（办公）地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507<br>法定代表人：钟斐斐<br>联系人：翟相彬<br>电话：010-61840688<br>传真：010-61840699<br>客户服务电话：400 0618 518<br>网址：http://danjuanapp.com/                            |
| 99  | 上海基煜基金销售有限公司 | 注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）<br>办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室<br>法定代表人：王翔<br>联系人：蓝杰<br>电话：021-65370077<br>传真：021-55085991<br>客户服务电话：4008205369<br>网址：www.jiyufund.com.cn |
| 100 | 南京途牛基金销售有限公司 | 注册地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号<br>办公地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号<br>法定代表人：宋时琳<br>联系人：王旋<br>电话：025—86853969<br>传真：025—86853960<br>客服电话：4007-999-999<br>网址：http://jr.tuniu.com                               |

|     |                  |   |
|-----|------------------|---|
| 101 | 上海钜派钰茂基金销售有限公司   | 注册地址：上海市浦东新区泥城镇新城路2号24幢N3187室<br>办公地址：上海市浦东新区浦东南路379号金穗大厦14楼C座<br>法定代表人：胡天翔<br>联系人：卢奕<br>电话：021-50793059<br>传真：021-68413161<br>客户服务电话：4006889967<br>网址： <a href="http://www.jp-fund.com/">http://www.jp-fund.com/</a>                 |
| 102 | 凤凰金信（银川）基金销售有限公司 | 注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402<br>办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院朝来高科技产业园18号楼<br>法定代表人：张旭<br>联系人：陈旭<br>电话：010-58160168<br>传真：010-58160173<br>客户服务电话：400-810-5919<br>网址： <a href="http://www.fengfd.com">www.fengfd.com</a>               |
| 103 | 北京微动利基金销售有限公司    | 注册地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼341室<br>办公地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼341室<br>法定代表人：梁洪军<br>联系人：季长军<br>电话：010-52609551<br>传真：010-51957430<br>客户服务电话：400-819-6665<br>网址： <a href="http://www.buyforyou.com.cn">www.buyforyou.com.cn</a> |
| 104 | 北京格上富信基金销售有限公司   | 注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室<br>办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室<br>法定代表人：李悦章<br>联系人：曹庆展<br>电话：010-65983311<br>传真：010-65983333<br>客户服务电话：400-066-8586<br>网址： <a href="http://www.igesafe.com">www.igesafe.com</a>                           |



|     |                 |  |
|-----|-----------------|--|
| 105 | 北京肯特瑞财富投资管理有限公司 | 注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06<br>办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层<br>法定代表人：陈超<br>联系人：江卉<br>电话：4000988511/4000888816<br>传真：010-89188000<br>客户服务电话：95118<br>网址：www.fund.jd.com           |
| 106 | 泛华普益基金销售有限公司    | 注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室<br>办公地址：四川省成都市锦江区东大街99号平安金融中心1501单元<br>法定代表人：于海锋<br>联系人：王峰<br>电话：028-84252474<br>传真：028-84252474<br>客户服务电话：4008-588-588<br>网址：https://www.puyifund.com/      |
| 107 | 上海华夏财富投资管理有限公司  | 注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室<br>办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层<br>法定代表人：李一梅<br>联系人：仲秋玥<br>电话：010-88066632<br>传真：010-88066214<br>客户服务电话：400-817-5666<br>网址：www.amcfortune.com                |
| 108 | 上海云湾基金销售有限公司    | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层<br>办公地址：上海市浦东新区锦康路308号陆家嘴世纪金融广场6号楼6层<br>法定代表人：戴新装<br>联系人：朱学勇<br>电话：021-20538888<br>传真：021-20538999<br>客户服务电话：400-820-1515<br>网址：www.zhengtongfunds.com |

|     |                  |  |
|-----|------------------|--|
| 109 | 上海挖财金融信息服务有限公司   | <p>注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、02、03 室<br/>                 办公地址： 中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、02、03 室<br/>                 法定代表人： 胡燕亮<br/>                 联系人： 义雪辉<br/>                 电话： 021 - 50810687<br/>                 传真： 021-58300279<br/>                 客户服务电话： 021-50810673<br/>                 网址： <a href="http://www.wacaijijin.com/">http://www.wacaijijin.com/</a></p> |
| 110 | 深圳秋实惠智基金销售有限公司   | <p>注册地址： 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室<br/>                 办公地址： 北京市朝阳区东三环北路 2 号南银大厦 2309<br/>                 法定代表人： 张秋林<br/>                 联系人： 张秋林<br/>                 电话： 010-64108876<br/>                 传真： 010-64108875<br/>                 客户服务电话： 010-64108876<br/>                 网址： <a href="http://fund.qiushicaifu.com">http://fund.qiushicaifu.com</a></p>                         |
| 111 | 大河财富基金销售有限公司     | <p>注册地址： 贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号<br/>                 办公地址： 贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号<br/>                 法定代表人： 王荻<br/>                 联系人： 方凯鑫<br/>                 电话： 0851-88405606<br/>                 传真： 0851-88405599<br/>                 客户服务电话： 0851-88235678<br/>                 网址： <a href="http://www.urainf.com">www.urainf.com</a></p>        |
| 112 | 通华财富（上海）基金销售有限公司 | <p>注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室<br/>                 办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 9 楼<br/>                 法定代表人： 马刚<br/>                 联系人： 杨徐霆<br/>                 电话： 021-60818249<br/>                 客户服务电话： 95156<br/>                 网址： <a href="http://www.tonghuafund.com">www.tonghuafund.com</a></p>  |

|     |                    |  |
|-----|--------------------|--|
| 113 | 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<br>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<br>法定代表人：任淑桢<br>联系人：周映筱<br>电话：010-66162800<br>传真：0532-66728591<br>客户服务电话：4006706863<br>网址：www.hongtaiwealth.com   |
| 114 | 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<br>办公地址：上海徐汇区桂平路391号B座19层<br>法定代表人：林琼<br>联系人：徐海峥<br>电话：021-60907379<br>传真：021-60907397<br>客户服务电话：021-60907378<br>网址：www.youyufund.com          |
| 115 | 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）<br>办公地址：大连市中山区南山路155号南山1910小区A3-1<br>法定代表人：苗宏升<br>联系人：王清臣<br>电话：0411-66889805<br>传真：0411-66889827<br>客户服务电话：4007-903-688                 |
| 116 | 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<br>办公地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼<br>法定代表人：贲惠琴<br>联系人：钟伟<br>电话：138-2642-0174<br>传真：021-50206001<br>客户服务电话：021-50206003<br>网址：http://www.msftec.com/ |

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

法定代表人：杨光裕

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：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：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

## （四）会计师事务所及经办注册会计师

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

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：许康玮、朱宏宇

#### 四、基金的名称

景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金

#### 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固定收益品种，同时适当投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票，在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，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

本基金的投资范围主要为依法发行的债券（包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离型可转换债券）、中央银行票据、中期票据、短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、同业存单、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证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，但需符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：

转型前“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”的投资组合比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 70%（开放期开始前 10 个工作日至开放期结束后 10 个工作日内不受此比例限制），股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，封闭期内不受前述 5% 的限制。

转型为“景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金”的投资组合比例：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 70%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到

期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

## 八、基金的投资策略

(一) 转型前“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”的投资策略

本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、期限配置策略、固定收益类资产投资策略、权益资产投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合资产的增值。

### 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，把握不同的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、权益类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。

### 2、期限配置策略

为合理控制本基金开放期的流动性风险，并满足每次开放期的流动性需求，本基金在每个封闭期将适当的采取期限配置策略，即将基金资产所投资标的的平均剩余存续期限与基金封闭期限进行适当的匹配。

### 3、固定收益类资产投资策略

#### (1) 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、分离交易可转债债券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。

#### (2) 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期限结构策略

收益率曲线形状变化的主要影响因素是宏观经济基本面以及货币政策，而投资者的期限偏好以及各期限的债券供给分布对收益率形状有一定影响。对收益率曲线的分析采取定性和定量相结合的方法。

定性方法为：在对经济周期和货币政策分析下，对收益率曲线形状可能变化给予一个方向判断；

定量方法为：参考收益率曲线的历史趋势，同时结合未来的各期限的供给分布以及投资者的期限偏好，对未来收益率曲线形状做出判断。在对于收益率曲线形状变化和变动幅度做出判断的基础上，结合情景分析结果，提出可能的期限结构配置策略，包括：子弹型策略、哑铃型策略、梯形策略等。

### ②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况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。

### ③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评分，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）则主要采取实地调研和电话会议等形式实施。

### ④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，通过债券的收益率的下滑，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。

### （3）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、资产池结构以及资产池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与收益率的影响。同时，基金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。

### （4）杠杆策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时，基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。

### （5）可转换债券投资策略

#### ①相对价值分析

基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析可转换债券股性和债性的相对价值。通过对可转换债券转股溢价率和 Delta 系数的度量，筛选出股性或债性较强的品种作为下一阶段的投资重点。

#### ②基本面研究

基金管理人依据内、外部研究成果，运用景顺长城股票研究数据库（SRD）对可转换债券标的公司进行多方位、多角度的分析，重点选择行业景气度较高、公司基本面素质优良的标的公司。

#### ③估值分析

在基本面分析的基础上，运用 PE、PB、PCF、EV/EBITDA、PEG 等相对估值指标以及 DCF、DDM 等绝对估值方法对标的公司的股票价值进行评估。并根据标的股票的当前价格和目标价格，运用期权定价模型分别计算可转换债券当前的理论价格和未来目标价格，进行投资决策。

## 4、权益资产投资策略



### （1）股票投资策略

本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，本基金将从定性及定量两个方面加以考察分析投资标的，在定性分析方面重点关注：

①成长性（growth）。重点关注企业生存和发展的外部环境，企业享有国家相关的优惠政策的变化，企业关键技术模仿难易程度、和产品定位等。

#### ②业务价值（Franchise Value）

重点关注拥有高进入壁垒的上市公司，其一般具有以下一种或多种特征：产品定价能力、创新技术、资金密集、优势品牌、健全的销售网络及售后服务、规模经济等。在经济增长时它们能创造持续性的成长，经济衰退时亦能度过难关，享有高于市场平均水平的盈利能力，进而创造高业务价值，达致长期资本增值。

③竞争优势（competitive advantage）。重点关注企业的市占率概况、技术优势、创新体制和开发能力、专利权和法规限制、和渠道关系等

#### ④管理能力（Management）

重点关注公司治理、企业的质量管理、公司的销售网络、管理层的稳定性以及管理班子的构成、学历、经验等，通过实地考察了解其管理能力以及是否诚信。以及企业的战略实施等。

#### ⑤自由现金流量与分红政策（Cash Generation Capability）

重点关注企业创造现金流量的能力以及稳定透明的分红派息政策。衡量企业绩效的最终标准在于投资人的长期现金报酬，企业除了需要拥有良好的利润增长以外，也需要能创造足够现金流以供派息和再投资之用。在会计准则弹性太大，盈利容易被操纵的时候，此标准尤其重要，因为创造现金与分红能力永远是一家企业素质的最好体现。

在定量分析方面重点关注：

①盈利能力。主要指标有资产收益率（ROA）、净资产收益率（ROE）等。

②成长潜力。主要指标有销售收入增长率、净利润增长率等。

③偿债能力。关注目标公司的资产负债结构以及资产流动性状况，重点分析的指标有资产负债率、流动比率、货币资金/总资产、利息保障倍数等。

④估值。主要指标有市盈率（PE）、市盈增长比率（PEG）、市净率（PB）、市现率（PCF）、市销率（PS）、企业价值倍数（EV/EBITDA）等。

对成长、价值、收益三类股票设定不同的估值指标。

成长型股票（G）：用来衡量成长型上市公司估值水平的主要指标为 PEG，即市盈率除

以盈利增长率。为了使投资人能够达到长期获利目标，我们在选股时将会谨慎地买进价格与其预期增长速度相匹配的股票。

价值型股票（V）：分析股票内在价值的基础是将公司的净资产收益率与其资本成本进行比较。我们在挑选价值型股票时，会根据公司的净资产收益率与资本成本的相对水平判断公司的合理价值，然后选出股价相对于合理价值存在折扣的股票。

收益型股票（I）：是依靠分红取得较好收益的股票。我们挑选收益型股票，要求其保持持续派息的政策，以及较高的股息率水平。

⑤流动性分析。主要指标有市场流通量、股东分散性等。

以上个股考察中不可或缺的部分是合理性分析。因此在研究公司业绩及对公司前景做出预测时，都会对有关公司的业绩和盈利能力做出详细的合理性研究。其中包括把公司的盈利能力与国内同行业的公司作比较、追踪公司的主要生意对手，如供应商、客户、竞争对手等的表现、参考国外同业公司的表现与赢利能力等，务求从多方位评估公司本身的业绩合理性与业务价值。

## （2）权证投资策略

本基金不直接购买权证等衍生品资产，但有可能持有所持股票所派发的权证或因投资分离交易可转债而产生的权证等。本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，结合权证的溢价率、隐含波动率等指标选择权证的卖出时机。

## （二）转型为“景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金”的投资策略

本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、固定收益类资产投资策略、权益资产投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合资产的增值。

### 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，把握不同的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、权益类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。

### 2、固定收益类资产投资策略

#### （1）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、分离交易可转债债券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。

## （2）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期限结构策略

收益率曲线形状变化的主要影响因素是宏观经济基本面以及货币政策，而投资者的期限偏好以及各期限的债券供给分布对收益率形状有一定影响。对收益率曲线的分析采取定性和定量相结合的方法。

定性方法为：在对经济周期和货币政策分析下，对收益率曲线形状可能变化给予一个方向判断；

定量方法为：参考收益率曲线的历史趋势，同时结合未来的各期限的供给分布以及投资者的期限偏好，对未来收益率曲线形状做出判断。在对于收益率曲线形状变化和变动幅度做出判断的基础上，结合情景分析结果，提出可能的期限结构配置策略，包括：子弹型策略、哑铃型策略、梯形策略等。

### ②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况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。

### ③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评分，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）则主要采取实地调研和电话会议等形式实施。

#### ④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，通过债券的收益率的下滑，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。

#### (3) 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、资产池结构以及资产池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与收益率的影响。同时，基金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。

#### (4) 杠杆策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时，基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。

#### (5) 可转换债券投资策略

##### ①相对价值分析

基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析可转换债券股性和债性的相对价值。通过对可转换债券转股溢价率和 Delta 系数的度量，筛选出股性或债性较强的品种作为下一阶段的投资重点。

##### ②基本面研究

基金管理人依据内、外部研究成果，运用景顺长城股票研究数据库（SRD）对可转换债券标的公司进行多方位、多角度的分析，重点选择行业景气度较高、公司基本面素质优良的标的公司。

### ③估值分析

在基本面分析的基础上，运用 PE、PB、PCF、EV/EBITDA、PEG 等相对估值指标以及 DCF、DDM 等绝对估值方法对标的公司的股票价值进行评估。并根据标的股票的当前价格和目标价格，运用期权定价模型分别计算可转换债券当前的理论价格和未来目标价格，进行投资决策。

## 3、权益资产投资策略

### （1）股票投资策略

本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略,本基金将从定性及定量两个方面加以考察分析投资标的，在定性分析方面重点关注：

①成长性（growth）。重点关注企业生存和发展的外部环境，企业享有国家相关的优惠政策的变化，企业关键技术模仿难易程度、和产品定位等。

### ②业务价值（Franchise Value）

重点关注拥有高进入壁垒的上市公司，其一般具有以下一种或多种特征：产品定价能力、创新技术、资金密集、优势品牌、健全的销售网络及售后服务、规模经济等。在经济增长时它们能创造持续性的成长，经济衰退时亦能度过难关，享有高于市场平均水平的盈利能力，进而创造高业务价值，达致长期资本增值。

③竞争优势（competitive advantage）。重点关注企业的市占率概况、技术优势、创新体制和开发能力、专利权和法规限制、和渠道关系等

### ④管理能力（Management）

重点关注公司治理、企业的质量管理、公司的销售网络、管理层的稳定性以及管理班子的构成、学历、经验等，通过实地考察了解其管理能力以及是否诚信。以及企业的战略实施等。

### ⑤自由现金流量与分红政策（Cash Generation Capability）

重点关注企业创造现金流的能力以及稳定透明的分红派息政策。衡量企业绩效的最终标准在于投资人的长期现金报酬，企业除了需要拥有良好的利润增长以外，也需要能创造足够现金流以供派息和再投资之用。在会计准则弹性太大，盈利容易被操纵的时候，此标准尤其重要，因为创造现金与分红能力永远是一家企业素质的最好体现。

在定量分析方面重点关注：

①盈利能力。主要指标有资产收益率（ROA）、净资产收益率（ROE）等。

②成长潜力。主要指标有销售收入增长率、净利润增长率等。

③偿债能力。关注目标公司的资产负债结构以及资产流动性状况，重点分析的指标有资产负债率、流动比率、货币资金/总资产、利息保障倍数等。

④估值。主要指标有市盈率（PE）、市盈增长比率（PEG）、市净率（PB）、市现率（PCF）、市销率（PS）、企业价值倍数（EV/EBITDA）等。

对成长、价值、收益三类股票设定不同的估值指标。

成长型股票（G）：用来衡量成长型上市公司估值水平的主要指标为 PEG，即市盈率除以盈利增长率。为了使投资人能够达到长期获利目标，我们在选股时将会谨慎地买进价格与其预期增长速度相匹配的股票。

价值型股票（V）：分析股票内在价值的基础是将公司的净资产收益率与其资本成本进行比较。我们在挑选价值型股票时，会根据公司的净资产收益率与资本成本的相对水平判断公司的合理价值，然后选出股价相对于合理价值存在折扣的股票。

收益型股票（I）：是依靠分红取得较好收益的股票。我们挑选收益型股票，要求其保持持续派息的政策，以及较高的股息率水平。

⑤流动性分析。主要指标有市场流通量、股东分散性等。

以上个股考察中不可或缺的部分是合理性分析。因此在研究公司业绩及对公司前景做出预测时，都会对有关公司的业绩和盈利能力做出详细的合理性研究。其中包括把公司的盈利能力与国内同行业的公司作比较、追踪公司的主要生意对手，如供应商、客户、竞争对手等的表现、参考国外同业公司的表现与赢利能力等，务求从多方位评估公司本身的业绩合理性与业务价值。

## （2）权证投资策略

本基金不直接购买权证等衍生品资产，但有可能持有所持股票所派发的权证或因投资分离交易可转债而产生的权证等。本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，结合权证的溢价率、隐含波动率等指标选择权证的卖出时机。

## 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）转型前，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 70%；但应开放期流动

性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前 10 个工作日至开放期结束后 10 个工作日内不受此比例限制，股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%；转型后，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 70%，股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%；

(2) 转型前，任一开放期内，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；转型后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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%；

(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) 转型前，本基金在封闭期内，基金的总资产不得超过基金净资产的 200%；在开放期内，基金的总资产不得超过基金净资产的 140%；转型后，基金的总资产不得超过基金净资产的 140%；

(6) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余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，债券回购到期后不展期；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；

(12) 转型前，任一开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%；转型后，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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本项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(13) 本基金与私募类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，可接受质押品的资质要求应当与投资范围保持一致；

(14) 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 个月内予以全部卖出；

(15) 本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(16) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(17) 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)、(12)、(13)、(14) 项规定外，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述规定投资比例的，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约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

法律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以变更后的规定为准。

## 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：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向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；
- (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。

基金管理人可以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者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不受上述限制或按调整后的规定执行。

## 九、基金的业绩比较基准

转型前“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”的业绩比较基准及转型为“景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金”的业绩比较基准均为：中证综合债指数收益率× 85%+ 沪深 300 指数收益率×15%

中证综合债券指数是中证指数有限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、央行票据及短融整体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切合的市场基准是适合作为本基金的业绩比较基准。沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本的综合性指数，具有良好的市场代表性。

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，在按照监管部门要求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、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

## 十一、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。

本基金的托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 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              | 27,670,399.19  | 7.02         |
|    | 其中：股票             | 27,670,399.19  | 7.02         |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 359,142,491.76 | 91.10        |
|    | 其中：债券             | 359,142,491.76 | 91.10        |
|    | 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      | 1,066,962.45   | 0.27         |
| 8  | 其他资产              | 6,334,973.08   | 1.61         |
| 9  | 合计                | 394,214,826.48 | 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         | 1,396,068.00  | 0.48         |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 24,320,539.19 | 8.34         |
| 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              | -             | -            |

|   |               |               |      |
|---|---------------|---------------|------|
| K | 房地产业          | -             | -    |
| L | 租赁和商务服务业      | -             | -    |
| 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     | 1,953,792.00  | 0.67 |
| S | 综合            | -             | -    |
|   | 合计            | 27,670,399.19 | 9.49 |

## 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  | 000651 | 格力电器 | 164,800 | 7,770,320.00 | 2.66         |
| 2  | 603899 | 晨光文具 | 177,191 | 5,615,182.79 | 1.93         |
| 3  | 000661 | 长春高新 | 19,900  | 4,531,230.00 | 1.55         |
| 4  | 002841 | 视源股份 | 82,240  | 4,392,438.40 | 1.51         |
| 5  | 002223 | 鱼跃医疗 | 103,200 | 2,011,368.00 | 0.69         |
| 6  | 603103 | 横店影视 | 63,600  | 1,953,792.00 | 0.67         |
| 7  | 300498 | 温氏股份 | 63,400  | 1,396,068.00 | 0.48         |

## 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      | 59,928,000.00  | 20.55        |
|    | 其中：政策性金融债 | 39,944,000.00  | 13.70        |
| 4  | 企业债券      | 9,967,000.00   | 3.42         |
| 5  | 企业短期融资券   | 140,449,000.00 | 48.16        |
| 6  | 中期票据      | 100,462,000.00 | 34.45        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 482,491.76     | 0.17         |
| 8  | 同业存单      | 47,854,000.00  | 16.41        |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 359,142,491.76 | 123.15       |

**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  | 111810021 | 18 兴业银行 CD021 | 400,000 | 38,288,000.00 | 13.13        |
| 2  | 101363003 | 13 深地铁 MTN001 | 200,000 | 20,274,000.00 | 6.95         |
| 3  | 101454027 | 14 大唐集 MTN001 | 200,000 | 20,168,000.00 | 6.92         |
| 4  | 041764022 | 17 太仓城投 CP001 | 200,000 | 20,160,000.00 | 6.91         |
| 5  | 011800306 | 18 赣高速 SCP002 | 200,000 | 20,074,000.00 | 6.88         |

**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

1. 2018年4月19日，因兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务等问题，中国银行保险监督管理委员会依据《商业银行与内部人和股东关联交易管理办法》第六条、第八条、第二十二、第二十五、第四十二、第四十四条，《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，《中国银监会关于规范信贷资产转让及信贷资产类理财业务有关事项的通知》第三条、第四条，《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，出具银保监银罚决字（2018）1号行政处罚决定书，处兴业银行罚款5870万元。

本基金投研人员认为，兴业银行作为全国性股份制商业银行，截至2017年底所有者权益合计4168.95亿元，年净利润超500亿，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兴业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。

### 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   | 67,479.22    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 6,267,493.86 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 6,334,973.08 |

**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。

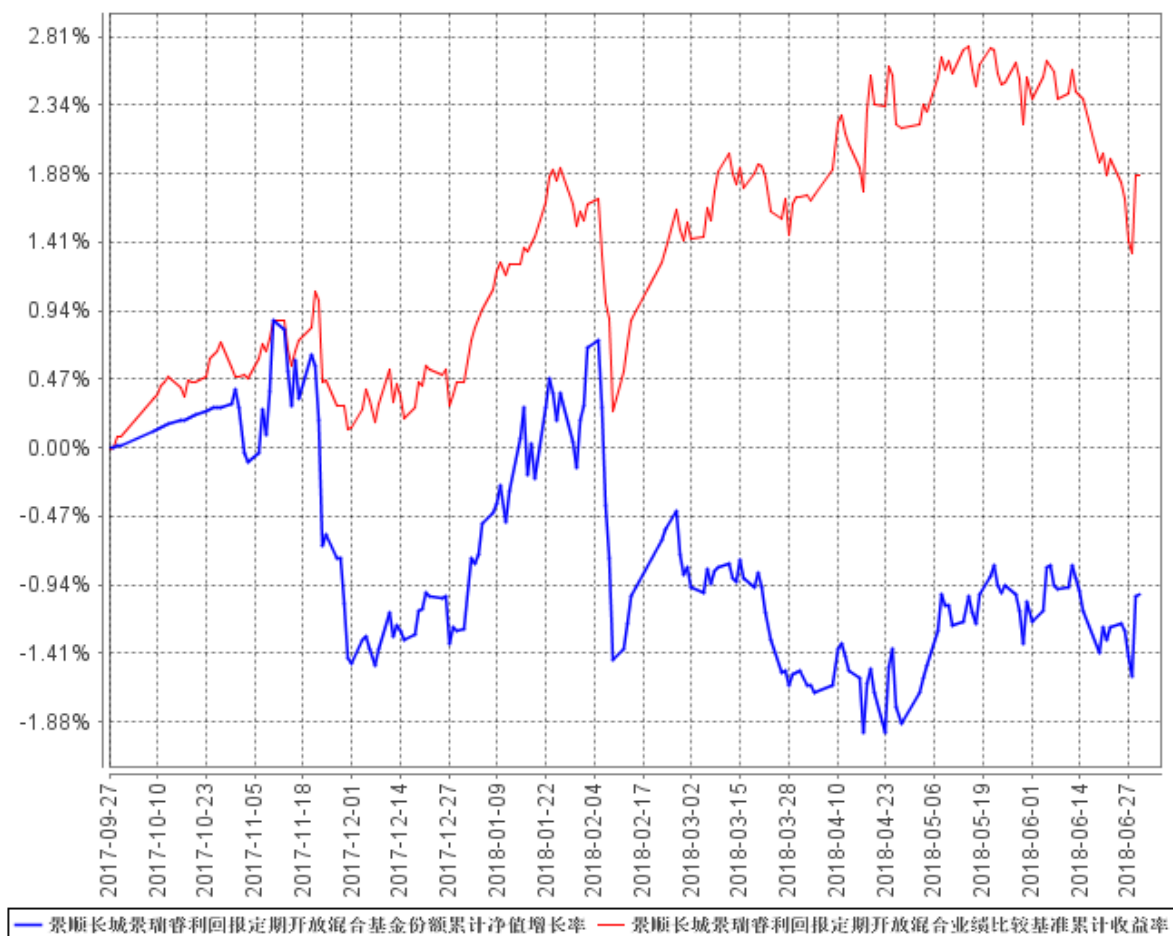
**十二、基金的业绩**

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基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2018 年 6 月 30 日。

**1、净值增长率与同期业绩基准收益率比较表**

| 阶段                         | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 2017年9月27日至<br>2017年12月31日 | -1.24%       | 0.19%               | 0.45%              | 0.13%                 | -1.69% | 0.06% |
| 2018年1月1日至<br>2018年6月30日   | 0.24%        | 0.22%               | 1.41%              | 0.18%                 | -1.17% | 0.04% |
| 2017年9月27日至<br>2018年6月30日  | -1.00%       | 0.21%               | 1.86%              | 0.16%                 | -2.86% | 0.05% |

**2、本基金自基金合同生效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比较**



注：本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 70%（开放期开始前 10 个工作日至开放期结束后 10 个工作日内不受此比例限制），股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，封闭期内不受前述 5% 的限制。本基金的建仓期为自 2017 年 9 月 27 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。基金合同生效日（2017 年 9 月 27 日）起至本报告期末不满一年。

### 十三、基金费用概览

#### 一、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、证券账户开户费用和银行账户维护费；
- 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

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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，基金管理人与基金托管人核对后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 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 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—9 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。

## 三、与基金销售有关的费用

### 1、基金认购费用

(1) 本基金在投资者认购时收取认购费，认购费率按认购金额递减，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，适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销中心认购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的认购费率。

拟实施特定认购费率的养老金客户范围包括基本养老保险基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基金，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。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本基金管理人也将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基金份额的养老金客户认购费率见下表：

| 认购金额 (M)          | 认购费率      |
|-------------------|-----------|
| M < 100 万         | 0.18%     |
| 100 万 ≤ M < 200 万 | 0.09%     |
| 200 万 ≤ M < 500 万 | 0.024%    |
| M ≥ 500 万         | 每笔 1000 元 |

其他投资者认购本基金份额认购费率见下表：

| 认购金额 (M)          | 认购费率      |
|-------------------|-----------|
| M < 100 万         | 0.60%     |
| 100 万 ≤ M < 200 万 | 0.30%     |
| 200 万 ≤ M < 500 万 | 0.08%     |
| M ≥ 500 万         | 每笔 1000 元 |

## (2) 计算公式

本基金认购份额的计算方法如下：

当认购费用适用比例费率时：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购期间利息) / 基金份额发售面值

当认购费用适用固定金额时：

认购费用 = 固定金额

净认购金额 = 认购金额 - 认购费用

认购份额 = (净认购金额 + 认购期间利息) / 基金份额发售面值

认购份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

## 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除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份额的养老金客户申购费率见下表：

| 申购金额 (M)          | 申购费率      |
|-------------------|-----------|
| M < 100 万         | 0.18%     |
| 100 万 ≤ M < 200 万 | 0.09%     |
| 200 万 ≤ M < 500 万 | 0.024%    |
| M ≥ 500 万         | 每笔 1000 元 |

其他投资者申购本基金份额申购费率见下表：

| 申购金额 (M)          | 申购费率      |
|-------------------|-----------|
| M < 100 万         | 0.60%     |
| 100 万 ≤ M < 200 万 | 0.30%     |
| 200 万 ≤ M < 500 万 | 0.08%     |
| M ≥ 500 万         | 每笔 1000 元 |

### (2) 计算公式

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，以申请当日基金份额净值为基准计算。

本基金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：

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

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

当申购费用适用固定金额时：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

上述计算结果按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

### 3、基金赎回费用

(1) 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。对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人收取的赎回费，应当将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产；其余用于支付注册登记费等相关手续费。

| 持有期限      | 赎回费率  |
|-----------|-------|
| 30 天以内    | 1.5%  |
| 30 天以上（含） | 0.00% |

#### (2) 计算公式

在本基金开放期内赎回基金份额，赎回金额为按实际确认的有效赎回份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。

其中：

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

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

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

上述计算结果按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

### 四、不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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

1、在“第三部分、基金管理人”部分，更新了基金管理人董事会成员、监事会成员、高级管理人员、基金经理、投资决策委员会委员的相关信息；

2、在“第四部分、基金托管人”部分，更新了托管人相关情况信息；

3、在“第五部分、相关服务机构”部分，更新了基金份额销售机构的相关信息；

4、在“第十部分、基金的投资”部分，更新了基金的投资组合报告，数据截至 2018 年 6 月 30 日；

5、更新了“第十一部分、基金的业绩”，数据截至 2018 年 6 月 30 日；

6、在“第二十三部分、其它应披露事项”部分，更新了近期发布的与本基金有关的公告目录，目录更新至 2018 年 9 月 27 日。

景顺长城基金管理有限公司

二〇一八年十一月十日