（上接B91版）

办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人：袁顺明
联系人：何旺宇
电话：13917225742
传真：021-22268089
客户服务电话：400-928-2266/021-22267995
网址：www.dtfunds.com
（109）中证金牛（北京）投资咨询有限公司
注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
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
法定代表人：彭运华
联系人：孙雯
电话：010-59336519
传真：010-59336500
客户服务电话：4008-909-998
网址：www.jnlc.com
（110）奕丰金融服务（深圳）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（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室
法定代表人：TAN YIK KUAN
联系人：项晶晶
电话：0755-89460500
传真：0755-21674453
客户服务电话：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn
（111）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
法定代表人：李淑慧
联系人：裴小龙
电话：0371-55213196
传真：0371-88518397
客户服务电话：400-0555-671
网址：www.hgcpb.com
（112）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
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈继武
联系人：李晓明
电话：021-63333319
传真：021-63332523
客户服务电话：4000 178 000
网址：www.lingxianfund.com
（113）深圳市金斧子投资咨询有限公司
注册地址：深圳市南山区南山街道科苑路18号东方科技大厦18F
法定代表人：陈姚坚
联系人：陈茹、张烨
电话：0755-84034499
传真：0755-84034477
客户服务电话：400-9500-888
网址：http://www.jfzinv.com/
（114）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
法定代表人：陶捷
联系人：孔繁
电话：18627239925
客户服务电话：027-87006003
网址：www.buyfunds.cn
(115)浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室
法定代表人：徐黎云
联系人：孙成岩
电话：0571-88337717
传真：0571-88337666
客户服务电话：400-068-0058
网址：www.jincheng-fund.com
(116)北京汇成基金管理有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王伟刚
联系人：丁向坤
电话：010-56282140
传真：010-62680827
客户服务电话：4006199059
网址：www.fundtone.cn
（117）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
法定代表人：钱燕飞
联系人：王锋
电话：025-66996699-887226
传真：025-66996699
客户服务电话：95177
网址：www.snjijin.com
（118）上海天智慧财富管理有限公司
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
法定代表人：申健
联系人：印强明
电话：021-20219988
传真：021-20219988
客户服务电话：021-20219931
网址：https://8.gw.com.cn/
（119）北京广源达信投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
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
法定代表人：齐剑辉
联系人：王英俊
电话：010-57298634
客服电话：4006236060
传真：010-82055860
网址：www.niuniufund.com
（120）上海中正达广投资管理有限公司
注册（办公）地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人：黄欢
联系人：戴取微
电话：021-33768132
传真：021-33768132-802
客户服务电话：400-6767-523
网址：www.zzwealth.cn
（121）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
法定代表人：刘惠
联系人：毛林
电话：021-80133597
传真：021-80133413
客户服务电话：400-808-1016
网址：www.fundhaiyin.com
(122)上海万得投资顾问有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼
法定代表人：王廷富
联系人：姜吉灵
电话：021-5132 7185
传真：021-5071 0161
客户服务电话：400-821-0203
(123)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）
办公地址：深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A
法定代表人：高锋
联系人：廖苑兰
电话：0755-83655588
传真：0755-83655518
客户服务电话：4008048688
网址：www.keynesaset.com
(124)中民财富管理（上海）有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址：上海市黄浦区中山南路100号17层
法定代表人：弭洪军
联系人：茅昌青
电话：021-33355392
传真：021-63353736
客户服务电话：4008323291
网址：www.cmiwm.com
(125)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
办公地址：北京市朝阳区菁云路26号鹏润大厦B座19层
法定代表人：丁东华
联系人：郭宝亮
电话：010-59287984
传真：010-59287825
客户服务电话：4001110889
网址：www.gomefund.com
（126）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
法定代表人：钟坤梁
联系人：翟相彬
电话：010-61840688
传真：010-61840699
客户服务电话：4000618518
网址：http://danjuanapp.com/
（127）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）
办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人：王翔
联系人：蓝杰
电话：021-65370077
传真：021-55085991
客户服务电话：4008205369
网址：www.jiyufund.com.cn
（128）南京途牛金融信息服务有限公司
注册地址：南京市玄武区玄武大道699-1号
办公地址：南京市玄武区玄武大道699-1号
法定代表人：宋时琳
联系人：王旋
电话：025-86853969
传真：025-86853960
客服电话：4007-999-999
网址：http://jr.tuniu.com
注：1、目前华侨银行和东亚银行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、目前星展银行和上海农商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、目前数米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。
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：杨光裕
电话：（0755）82370388—1668
传真：（0755）22381325
联系人：杨婉
（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：单峰、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、分级分级规则：

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

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

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、产行业运行景气状况及政策分析，做出产行业偏好选择，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”的选券和债券品种配置。

（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维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老市场尚未正确定价的创新品种

（3）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，积极实施时机策略。

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：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%。

货币市场基金：自2010年4月30日起，本基金的业绩比较基准由原先的“税后一年期定期存款利率”变更为“税后同期平天存款利率”。当市场上有更加适合的业绩比较基准，在不损害投资者利益的前提下，基金管理人有权按照相关规定对本基金的业绩比较基准进行变更并公告。

动力平衡基金：自2010年1月29日起，动力平衡的业绩比较基准由原先的“一年期银行定期存款年利率的2倍”变更为“沪深300指数收益率×50%＋中国债券总指数收益率×45%＋ 银行同业存款收益率×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群体。

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，该基金还将独立地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2016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	1,015,327,224.25	73.33
	其中：股票	1,015,327,224.25	73.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	285,940,269.05	20.65
	其中：债券	285,940,269.05	20.65
	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	76,616,116.30	5.53
8	其他资产	6,747,280.78	0.49
9	合计	1,384,630,890.38	100.00

2. 报行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	40,707,868.59	2.97
C	制造业	830,779,588.13	60.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	45,750.11	0.00
F	批发和零售业	32,547.63	0.00
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	41,727,615.37	3.04
J	金融业	103,187.78	0.01
K	房地产业	42,772,521.44	3.12
L	租赁和商务服务业	47,638,156.72	3.47
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,519,988.48	0.84
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	1,015,327,224.25	73.99

2.2 报告期末按行业分类的沪港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	000967	盈峰环境	5,435,055	85,221,662.40	6.21
2	300145	中金环境	2,991,189	79,356,244.17	5.78
3	300203	聚光科技	2,200,276	72,367,077.64	5.27
4	600517	置信电气	6,184,717	66,609,402.09	4.85
5	000820	金城股份	2,101,718	52,437,864.10	3.82
6	000049	德赛电池	1,172,542	48,660,493.00	3.55
7	002664	信质电机	1,887,001	47,854,345.36	3.49
8	300058	蓝色光标	4,419,124	47,638,156.72	3.47
9	300207	欣旺达	2,971,676	45,912,394.20	3.35
10	000333	美的集团	1,648,870	44,535,978.70	3.25

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	280,170,000.00	20.42
	其中：政策性金融债	280,170,000.00	20.42
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）	5,770,269.05	0.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	285,940,269.05	20.84

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	160401	16农发01	800,000	80,040,000.00	5.83
2	160204	16国开04	800,000	80,000,000.00	5.83
3	160414	16农发14	500,000	50,085,000.00	3.65
4	110417	11农发17	500,000	50,045,000.00	3.65
5	160209	16国开09	200,000	20,000,000.00	1.46

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	233,856.91
2	应收证券清算款	210,898.33
3	应收股利	-
4	应收利息	5,607,662.74
5	应收申购款	694,862.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,747,280.78

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	123001	蓝标转债	5,770,269.05	0.42

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	299,866,965.55	47.31
	其中：债券	299,866,965.55	47.31
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	184,501,276.75	29.11
	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	145,300,576.26	22.93
4	其他资产	4,114,175.62	0.65
5	合计	633,782,994.18	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143,500,000.00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	0.81
	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	63
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	66
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

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	37.99	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	26.13	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	10.11	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	9.50	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天（含）	15.82	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.55	-

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	49,998,095.64	7.90
	其中：政策性金融债	49,998,095.64	7.90
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	170,204,847.95	26.91
6	中期票据	-	-
7	同业存单	79,664,021.96	12.59
8	其他	-	-
9	合计	299,866,965.55	47.41
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	011699583	16国电SCP003	400,000	40,081,064.64	6.34
2	011698287	16苏交通SCP012	400,000	39,997,394.65	6.32
3	011606003	16电网SCP003	300,000	30,055,882.85	4.75
4	111611178	16平安CD178	300,000	29,884,778.10	4.72
5	111611187	16平安CD187	300,000	29,880,952.02	4.72
6	011699998	16苏国信SCP006	200,000	20,034,003.86	3.17
7	011611006	16大唐集SCP006	200,000	20,019,867.69	3.16
8	011616005	16华电股SCP005	200,000	20,016,634.26	3.16
9	160204	16国开04	200,000	20,002,665.14	3.16
10	160209	16国开09	200,000	19,989,975.88	3.16

7. “影子定价”与“摊余成本”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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0417%
报告期内偏离度的最低值	0.0094%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0293%

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

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。

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	2,179,604.59
4	应收申购款	1,934,571.03
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,114,175.62

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	1,284,764,024.40	66.88
	其中：股票	1,284,764,024.40	66.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	412,127,000.00	21.45
	其中：债券	412,127,000.00	21.45
	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	119,970,699.96	6.25
	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	98,234,342.49	5.11
8	其他资产	5,856,550.39	0.30
9	合计	1,920,952,617.24	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	1,149,008,733.60	59.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,479,438.16	3.00
E	建筑业	45,750.11	0.00
F	批发和零售业	32,547.63	0.00
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	47,515,449.47	2.48
J	金融业	177,181.70	0.01
K	房地产业	30,504,923.73	1.59
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	-	-