



(上接 B133 版)		
136	北京百庭百盛基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区上地十街10号11层1101 办公地址:北京市西城区上地三街9号世纪科大厦 法定代表人:陈嘉阳 电话:400-4195270 传真:400-4195197 客户服务热线:40005 网址:www.baiyingfund.com
137	北京顺时代理有限公司	总部(办公)地址:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室 法定代表人:闫永强 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室 电话:13792520131 传真:021-50701051 客户服务热线:021-50701051 网址:www.shunshitong.com/100045_yzsh
138	江苏林煜大基基金销售有限公司	注册地址:南京市雨花台区铁岗营社区宏业大厦47号 办公地址:南京市雨花台区铁岗营社区宏业大厦2005室 法定代表人:吴海峰 电话:025-66061666 传真:025-66061666 客户服务热线:025-66061666 网址:www.linyu-fund.com
139	鹏盛(北京)投资管理有限公司	总部(办公)地址:北京市西城区东月宫3号楼5层521室 法定代表人:李海峰 注册地址:北京市西城区东月宫3号楼5层521室 电话:010-82098611 传真:010-82098610 客户服务热线:400-158-5050 网址:www.baidun.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、登记机构

名称:景顺长城基金管理有限公司
住所:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
法定代表人:丁益
电话:(0755-82370388-1646
传真:(0755-22381325
联系人:邹昱
三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:(021-31358666
传真:(021-31358660
经办律师:吕红、孙春
联系人:孙春
四、审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人:毛贻宁
电话:(010)58153000
传真:(010)58108208
经办注册会计师:吕华、高鹤

四、基金名称
景顺长城景兴信用增强债券型证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
本基金主要通过投资于信用债券类资产,在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益,为投资者提供长期稳定的回报。

七、基金的投资方向
本基金的投资范围包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、银行存款、通知存款、定期存款、资产支持证券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。
本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的80%,其中对信用债券的投资比例不低于非现金基金资产的80%。本基金所指信用债包括:短期融资券、企业债、公司债、金融债(不含政策性金融债)、地方政府债、次级债、资产支持证券等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用的固定收益类金融工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。

本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场的新股申购或增发新股。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

1.资产配置策略
本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置,把握不同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、货币类等各类资产的预期收益率水平,结合各类资产的波动性以及流动性状况分析,进行大类资产配置。
2.债券类属资产配置
基金管理人根据国债、金融债、企业(公司)债、可分离交易可转债的纯债部分等品种与同期限国债或央票之利息收益率利差的扩大和收窄的分析,主动地增加预期利率将收窄的债券类属品种的投资比例,降低预期利率将扩大的债券类属品种的投资比例,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。
3.债券投资策略
债券投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用策略和时点策略相结合的积极性投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

(1)利率预期策略
基金管理人密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势,在此基础上预测市场利率水平变动趋势,以及收益率曲线变化趋势,在预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情景制定相应的债券组合期限结构策略如子弹型组合、哑铃型组合或阶梯型组合等。
(2)信用策略
基金管理人密切跟踪国债、金融债、企业(公司)债等不同债券种类的利差水平,结合各类券种税收状况、流动性状况以及发行人信用质量状况的分析,评定不同债券类属的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类属之间的配置比例。
个券选择层面,基金管理人自建债券研究资料库,并对所有投资的信用品种进行详细的财务分析和非财务分析后,进行各券选择。财务分析方面,以企业财务报表为依据,对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行评价,非财务分析方面(包括管理实力、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。
(3)时点策略

1 公告基本信息		
基金名称	中信保诚中债1-3年国开债指数证券投资基金	
基金简称	中信保诚中债1-3年国开	
基金代码	008454	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年5月28日	
基金管理人名称	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人名称	兴业银行股份有限公司	
基金注册登记机构名称	中信保诚基金管理有限公司	
公告依据	(中信保诚中债1-3年国开行债券指数证券投资基金合同)、(中信保诚中债1-3年国开行债券指数证券投资基金招募说明书)	
申购赎回开始日	2020年6月1日	
赎回开始日	2020年6月1日	
转换转入开始日	2020年6月1日	
转换转出开始日	2020年6月1日	
定期定额投资起始日	2020年6月1日	
下属各级基金的基金简称	中信保诚中债1-3年国开A	中信保诚中债1-3年国开C
下属各级基金的交易代码	008455	
该分级基金是否实施申购、赎回、转换、定期定额投资	是	是

2 日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的办理时间
投资人在开放日办理中信保诚中债1-3年国开债券指数证券投资基金(以下简称“本基金”)基金份额的申购、赎回、转换、定期定额投资业务,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定可暂停申购、赎回时除外。
基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。
3 日常申购业务
3.1 申购金额限制
1.通过销售机构申购本基金的单笔最低金额为1元(含申购费)人民币,各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。
2.投资人通过本公司直销中首次申购最低金额为10万元(含申购费)人民币,追加申购最低金额1000元(含申购费)人民币。本基金直销中单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。
3.已有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制,但追加申购最低金额的限制。其它销售机构网点的投资人欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。
4.基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过20%,或者变相规避20%集中度的情形时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。
当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限,拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。
5.基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备

i 认购策略。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,从而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,从而从此债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券收益率的下降,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,可以买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券,通过两债券利差的缩小获得投资收益;当预期利差水平扩大时,可以买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券,通过两债券利差的扩大获得投资收益。
4.资产支持证券投资策略
本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产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和收益率的影响,同时,管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响,综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。
5.中小企业私募债券投资策略
对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面,本基金加强自下而上的分析,将机构评级与内部评级相结合,着重通过发行方的财务状况、信用背景、盈利能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力,尽可能对发行主体进行深入详尽地调研和分析。

九、业绩比较基准
中证综合债券指数
中证综合债券指数是中证指数公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短期融资券等的跨市场债券指数,其选择是在中证债指数样本的基础上,增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债,该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,为债券投资者提供更为切合的市场基准是适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金,或者未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,在履行相应程序的前提下对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和本基金托管人协商一致,按有关规定及时公告,并报中国证监会备案,无需经基金份额持有人大会决议。

十、风险收益特征
本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》,基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险等级划分,风险评级等级为不改变本基金的实际风险收益特征,但由于风险等级划分标准的变化,本基金的风险等级表述上可能有相应变化,具体风险评级结果应当以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

十一、投资组合报告(已经审计)
景顺长城基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国建设银行根据基金合同规定,已经复核了本投资组合报告,保证报告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2019年12月31日,本报告中所有财务数据已经审计。
1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	债券投资	-	-
3	固定收益投资	2,077,890,658.10	96.82
4	货币资金	2,077,890,658.10	96.82
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式结构的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和拆借资金合计	42,674,203.77	1.99
9	其他资产	25,620,930.16	1.00
10	合计	2,146,185,870.03	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
3.报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票投资。
4.报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。

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	4,002,400.00	0.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	126,067,000.00	6.07
	其中:政策性金融债	126,067,000.00	5.60
4	企业债券	130,480,258.10	11.12
5	企业短期融资券	932,917,000.00	43.52
6	中期票据	675,341,000.00	31.50
7	可转换债券(可交换债)	-	-
8	资产支持证券	97,890,658.10	4.53
9	其他	-	-
10	合计	2,077,890,658.10	96.93

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
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
7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
9.1 本期国债期货投资策略

本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
9.1 本期国债期货投资策略

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	101909020	19广机债 MTN002	1,600,000	161,216,000.00	7.52
2	101908557	19中交债 MTN001	1,500,000	151,100,000.00	7.08
3	011908708	19广机债 SCP001	1,200,000	120,600,000.00	5.63
4	190201	19国开01	1,200,000	120,036,000.00	5.60
5	011759444	17中金债 MTN002	1,000,000	101,270,000.00	4.72

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
7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
9.1 本期国债期货投资策略

本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
9.1 本期国债期货投资策略

本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
9.1 本期国债期货投资策略

本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
9.1 本期国债期货投资策略

根据本基金基金合同约定,本基金投资范围不包括国债期货。
9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
9.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。
10. 投资组合报告附注
10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
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。
10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
本基金投资范围不包括股票投资。
10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,770.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,541,205.60
5	应收申购款	75,954.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,620,930.16

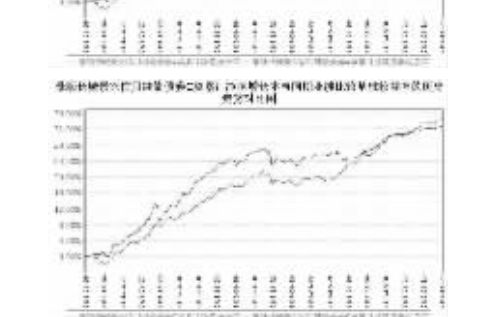
10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票投资。
10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
无。

景顺长城领先信用纯债债券C类						
阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
2013年8月26日至2013年12月31日	0.00%	0.07%	-1.58%	0.09%	2.08%	-0.02%
2014年	9.15%	0.17%	9.75%	0.08%	-0.60%	0.09%
2015年	12.22%	0.08%	7.95%	0.07%	4.27%	0.01%
2016年	0.57%	0.09%	2.12%	0.08%	-1.55%	0.01%
2017年	1.45%	0.06%	0.28%	0.05%	1.17%	0.01%
2018年	3.03%	0.10%	8.12%	0.06%	-5.09%	0.04%
2019年	2.61%	0.04%	4.67%	0.05%	-2.06%	-0.01%
2013年8月26日至2019年12月31日	32.78%	0.10%	35.13%	0.07%	-2.35%	0.03%

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

基金合同生效以来基金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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
2013年8月26日至2013年12月31日	0.50%	0.07%	-1.58%	0.09%	2.08%
2014年	9.15%	0.17%	9.75%	0.08%	-0.60%
2015年	12.22%	0.08%	7.95%	0.07%	4.27%
2016年	0.57%	0.09%	2.12%	0.08%	-1.55%
2017年	1.45%	0.06%	0.28%	0.05%	1.17%
2018年	3.03%	0.10%	8.12%	0.06%	-5.09%
2019年	2.61%	0.04%	4.67%	0.05%	-2.06%
2013年8月26日至2019年12月31日	32.78%	0.10%	35.13%	0.07%	-2.35%



注:本基金资产配置比例:本基金投资债券资产比例不低于基金资产的80%,其中对信用债券的投资比例不低于非现金资产的80%。本基金的建仓期为自2013年8月26日基金合同生效起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。

十三、基金费用概览
一、与基金运作有关的费用
(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.本基金C类基金份额计提的销售服务费;
(二)、基金费用计提标准、计提方式和支付方式
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0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:
$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初3个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令,费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。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4—10项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
二、与基金销售有关的费用
(1)本基金A类基金份额在投资者认购时收取认购费,C类基金份额在认购时不收取认购费,投资者在认购A类基金份额时需缴纳的认购费率按认购金额递减,投资者认购需全额缴纳认购费用,认购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用发生的各项费用,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。
本基金对通过直销柜台认购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别化的费率。
拟实施特定申购费率的养老金客户范围包括基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括:
1.全国社会保障基金;
2.以投资债券的地方社会保障基金;
3.企业年金单一计划以及集合计划。
如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老金类型,基金管理人也将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柜台认购本基金A类基金份额的养老金客户认购费率见下表:

认购金额(M)	A类份额认购费率
M<50万	0.24%
50万≤M<200万	0.12%
200万≤M<500万	0.08%
M≥500万	1000元/笔

其他投资者认购本基金A类基金份额认购费率见下表:

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

(2)计算公式
①认购A类基金份额时,认购费率的计算方法如下:
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)/基金份额初始净值
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)/基金份额初始净值
②认购C类基金份额时,认购费率的计算方法如下:
认购份额=(认购金额+认购期间利息)/基金份额初始净值
基金认购采取金额认购的方式,认购金额计算结果按照四舍五入的方法,保留小数点后两位,认购期间利息计入认购金额中,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。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4—10项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
三、与基金销售有关的费用
(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.本基金C类基金份额计提的销售服务费;
(二)、基金费用计提标准、计提方式和支付方式
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0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:
$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初3个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令,费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。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4—10项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
二、与基金销售有关的费用
(1)本基金A类基金份额在投资者认购时收取认购费,C类基金份额在认购时不收取认购费,投资者在认购A类基金份额时需缴纳的认购费率按认购金额递减,投资者认购需全额缴纳认购费用,认购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用发生的各项费用,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。
本基金对通过直销柜台认购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别化的费率。
拟实施特定申购费率的养老金客户范围包括基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括:
1.全国社会保障基金;
2.以投资债券的地方社会保障基金;
3.企业年金单一计划以及集合计划。
如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老金类型,基金管理人也将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柜台认购本基金A类基金份额的养老金客户认购费率见下表:

认购金额(M)	A类份额认购费率
M<50万	0.24%
50万≤M<200万	0.12%
200万≤M<500万	0.08%
M≥500万	1000元/笔

其他投资者认购本基金A类基金份额认购费率见下表:

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

(2)计算公式
①认购A类基金份额时,认购费率的计算方法如下:
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)/基金份额初始净值
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)/基金份额初始净值
②认购C类基金份额时,认购费率的计算方法如下:
认购份额=(认购金额+认购期间利息)/基金份额初始净值
基金认购采取金额认购的方式,认购金额计算结果按照四舍五入的方法,保留小数点后两位,认购期间利息计入认购金额中,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。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4—10项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
三、与基金销售有关的费用
(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.本基金C类基金份额计提的销售服务费;
(二)、基金费用计提标准、计提方式和支付方式
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0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:
$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初3个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令,费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。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4—10项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
二、与基金销售有关的费用
(1)本基金A类基金份额在投资者认购时收取认购费,C类基金份额在认购时不收取认购费,投资者在认购A类基金份额时需缴纳的认购费率按认购金额递减,投资者认购需全额缴纳认购费用,认购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用发生的各项费用,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。
本基金对通过直销柜台认购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别化的费率。
拟实施特定申购费率的养老金客户范围包括基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括:
1.全国社会保障基金;
2.以投资债券的地方社会保障基金;
3.企业年金单一计划以及集合计划。
如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老金类型,基金管理人也将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柜台认购本基金A类基金份额的养老金客户认购费率见下表:

通过基金管理人的直销柜台认购本基金A类基金份额的养老金客户认购费率见下表:

信息披露 | Disclosure B134

投资者如申购C类基金份额,则申购费为0.本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用,不列入基金财产。
(2)计算公式
A类基金份额申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后,以申请当日A类基金份额净值为基准计算,申购份额的计算结果按截断法去尾,保留小数点后两位,舍去部分所代表的资产归基金所有。
本基金的A类基金份额申购金额包括申购费用和净申购金额,其中:
当申购费用适用比例费率时:
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
当申购费用适用固定金额时:
申购费用=固定金额
净申购金额=申购金额-申购费用
申购份额=净申购金额/ T日基金份额净值
C类基金份额申购的有效份额为按实际确认的申购金额,以申请当日C类基金份额净值为基准计算,计算结果按截断法去尾的方法,保留小数点后两位,舍去部分所代表的资产归基金所有。
本基金的C类基金份额申购时不收取申购费用,申购金额即为净申购金额。
申购份额=净申购金额/ T日基金份额净值
3.基金赎回费用
本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。本基金销售服务费专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。
销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下:
$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值
销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初3个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,