



交银施罗德信用添利债券证券投资基金 （更新）招募说明书摘要 （2011年第1号）

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇一一年七月

【重要提示】

交银施罗德信用添利债券证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2010 年 11 月 12 日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】1601 号文核准募集。本基金基金合同于 2011 年 1 月 27 日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内采取封闭式运作，按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的情形除外。封闭期内，本基金在深圳证券交易所上市，基金投资者不能申购、赎回本基金基金份额。封闭期结束后本基金将转为上市开放式基金（LOF），转入开放期后基金投资者方可申购赎回本基金基金份额。基金合同生效后，若满足基金上市条件，则本基金将在基金合同生效后 3 个月内开始在深圳证券交易所上市交易。本基金上市交易后，通过场内认（申）购登记在证券登记系统的基金份额可以在深圳证券交易所上市交易；通过场外认（申）购登记在基金登记系统的基金份额通过跨系统转托管转至证券登记系统后方可上市交易。投资者可通过跨系统转托管业务实现基金份额在两个注册登记系统之间的转换。

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，需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，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金是一只债券型基金，属于基金中的中等风险品种，本基金的风险与预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合

型基金。

投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、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本基金合同的当事人，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》、《运作办法》、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。

本招募说明书所载内容截止日为 2011 年 7 月 27 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 6 月 30 日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙）

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 201 号渣打银行大厦 10 楼

邮政编码：200120

法定代表人：钱文挥

成立时间：2005 年 8 月 4 日

注册资本：2 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：陈超

电话：(021)61055050

传真：(021)61055034

交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准设立。公司股权结构如下：

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	65%
施罗德投资管理有限公司	30%
中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司	5%

（二）主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

钱文挥先生，董事长，硕士学历。现任交通银行股份有限公司执行董事，副行长。历任中国建设银行资产负债管理委员会办公室主任兼上海分行副行长、资产负债管理委员会办公室主任兼体制改革办公室主任兼上海分行副行长、资产负债管理部总经理、资产负债管理部总经理兼重组改制办公室主任、交通银行股份有限公司副行长兼上海分行行长。

雷贤达先生，副董事长，学士学历，加拿大证券学院和香港证券学院荣誉院士。历任巴克莱基金管理有限公司基金经理、施罗德投资管理（香港）有限公司执行董事、交银施罗德基金管理有限公司总经理。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员。

战龙先生，董事，总经理，CFA、CPA，硕士学历。历任安达信（新加坡）有限公司审计师，澳洲信孚基金管理有限公司投资风险管理副总监，信安资产管理亚洲有限公司投资风险管理总监，荷兰国际投资管理亚太有限公司中国区总经理，招商基金管理有限公司常务副总经理，富达国际中国董事总经理。

阮红女士，董事，博士学历。历任交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长、办公室综合处处长、交通银行海外机构管理部副总经理、总经理、交通银行上海分行副行长、交通银行资产托管部总经理，现任交通银行投资管理部总经理。

吴伟先生，董事，博士学历。历任交通银行总行财会部财务处主管、副处长，总行预算财务部副总经理、总经理，现任交通银行沈阳分行行长。

葛礼达先生，董事，大专学历。历任施罗德集团信息技术工作集团信息技术部董事、施罗德集团首席营运官，现任施罗德集团亚太地区总裁。

孙祁祥女士，独立董事，博士学历，国务院政府特殊津贴专家、博士生导师。现任北京大学经济学院副院长、风险管理及保险学系主任。

王松奇先生，独立董事，博士学历。历任中国人民大学讲师、中国社会科学院财贸所金融研究中心研究员，现任中国社会科学院金融研究中心副主任、研究员，北京创业投资协会常务副理事长、秘书长。

陈家乐先生，独立董事，博士学历。历任香港科技大学金融学系副教授、教授，现任香港科技大学金融学系系主任。

2、基金管理人监事会成员

康定选先生，监事长，EMBA，高级经济师。历任河南巩县农业银行信贷股信贷员、副股长，巩县支行副行长；郑州市农业银行行政区办事处副主任；交通银行郑州分行信贷部副主任、计划信贷处处长、副行长；交通银行南京分行副行长、行长；交通银行上海分行行长。

裴关淑仪女士，监事，CFA、CIPM、FRM，工商管理、资讯管理双硕士。曾任职荷兰银行、渣打银行（香港）有限公司、MIDAS-KAPITI INTERNATIONAL LIMITED，施罗德投资管理（香港）有限公司资讯科技部主管、中国事务联席董事。现任交银施罗德基金管理有限公司监察稽核及风险管理总监、总经理助理。

3、公司高管人员

钱文挥先生，董事长，硕士学历。简历同上。

战龙先生，董事，总经理，硕士学历。简历同上。

苏奋先生，督察长，纽约城市大学工商管理硕士。历任交通银行广州分行市场营销部总经理助理、副总经理，交通银行纽约分行信贷管理部经理、公司金融部经理、信用风险管理办公室负责人，交通银行投资管理部投资并购高级经理，交银施罗德基金管理有限公司综合管理部总监。

许珊燕女士，副总经理，硕士学历，高级经济师。历任湖南大学（原湖南财经学院）金融学院讲师，湘财证券有限责任公司国债部副经理、基金管理总部总经理，湘财荷银基金管理有限公司副总经理。

谢卫先生，副总经理，经济学博士，高级经济师。历任中央财经大学金融系教员；中国社会科学院财经所助理研究员；中国电力信托投资公司基金部副经理；中国人保信托投资公司证券部副总经理、总经理、北京证券营业部总经理、证券总部副总经理兼北方部总经理，富国基金管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

林洪钧先生，基金经理。学士学历。7 年证券、基金业从业经验。历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理，华安基金管理有限公司债券交易员，加拿大 Financial Engineering Source Inc. 金融研究员。2009 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任专户投资经理助理和专户投资经理。2011 年 1 月 27 日起担任本基金基金经理至今，并于 2011 年 6 月 9 日起兼任交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理至今。

5、投资决策委员会成员

委员：项廷锋（投资总监）

战龙（总经理）

史伟（权益部副总经理、基金经理）

张迎军（固定收益部副总经理、基金经理）

张科兵（研究部总经理、基金经理）

上述人员之间无近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、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 F9

法定代表人：项俊波

成立时间：2009 年 1 月 15 日

注册资金：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

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，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”。

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，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，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 130 名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、剪务能力强，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2011年7月27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103只,包括交银施罗德信用添利债券证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资

基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金。

（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）基金份额销售机构

1、直销机构

本基金直销机构为本公司以及本公司的网上交易平台。

机构名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙）

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 201 号渣打银行大厦 10 楼

法定代表人：钱文挥

成立时间：2005 年 8 月 4 日

电话：(021) 61055027

传真：(021) 61055054

联系人：许野

客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），(021) 61055000

网址：www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com

个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址：www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com。

2、场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深圳证券交易所网站查询）。

3、场外代销机构

(1) 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：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

传真：(010) 85109219

联系人：滕涛

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(2) 交通银行

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：(021) 58781234

传真：（021）58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(3) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

电话：（010）65557083

传真：（010）65550827

联系人：丰靖

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

(4) 中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

电话：（010）57092615

传真：（010）57092611

联系人：董云巍

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

(5) 中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

办公地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：唐双宁

电话：（010）68098778

传真：（010）68560661

联系人：李伟

客户服务电话：95595

网址：www.cebbank.com

(6) 宁波银行股份有限公司

住所：宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

电话：(021) 63586210

传真：(021) 63586215

联系人：胡技勋

客户服务电话：96528（上海地区 962528）

网址：www.nbc.com.cn

(7) 北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

电话：(010) 66223584

传真：(010) 66226045

联系人：王曦

客户服务电话：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

(8) 深圳发展银行股份有限公司

住所：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

电话：(0755) 82088888

联系人：张青

客户服务电话：95501

网址：www.sdb.com.cn

(9) 华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴健

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(10) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：（021）22169999

传真：（021）22169134

联系人：刘晨

客户服务电话：10108998

网址：www.ebscn.com

(11) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：祝幼一

电话：（021）38676161

传真：（021）38670161

联系人：芮敏棋

客户服务电话：95521，400-8888-666

网址：www.gtja.com

(12) 中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

电话：（010）65186080

传真：（010）65182261

联系人：魏明

客户服务电话：4008-888-108

网址：www.csc108.com

（13） 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：（021）23219000

传真：（021）23219100

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：www.htsec.com

（14） 广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

传真：（020）87555305

联系人：肖中梅

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

网址：www.gf.com.cn

（15） 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

电话：（010）66568047

联系人：李洋

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

(16) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943636

联系人：黄健

客户服务电话：400-8888-111, 95565

网址：www.newone.com.cn

(17) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东民生路 1199 弄五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

电话：(021) 38565785

传真：(021) 38565955

联系人：谢高得

客户服务电话：400-8888-123

网址：www.xyzq.com.cn

(18) 申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：(021) 54033888

联系人：黄维琳

客户服务电话：(021) 962505

网址：www.sw2000.com.cn

(19) 华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市福田区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层

法定代表人：马昭明

电话：（0755）82492000

传真：（0755）82492962

联系人：盛宗凌

客户服务电话：95513，400-8888-555

网址：www.lhzq.com

(20) 国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(21) 华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：（025）84457777

传真：（025）84579768

联系人：樊昊

客户服务电话：（025）95597

网址：www.htsc.com.cn

(22) 中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

办公地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

电话：（0571）85776115

传真：（0571）85783771

联系人：俞会亮

客户服务电话：（0571）96598

网址：www.96598.com.cn

(23) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507—1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：张智河

电话：（0532）85022326

传真：（0532）85022605

联系人：吴忠超

客户服务电话：（0532）96577

网址：www.zxwt.com.cn

(24) 恒泰证券股份有限公司

住所：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：庞介民

电话：（0471）4979037

传真：（0471）4961259

联系人：王旭华

客户服务电话：（0471）4960762，（021）68405273

网址：www.cnht.com.cn

(25) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 楼

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦 16-26 楼

法定代表人：何如

电话：（0755）82130833

传真：（0755）82133952

联系人：齐晓燕

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(26) 国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

客户服务电话：400-8888-777

网址：www.gyzq.com.cn

(27) 东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

电话：（0431）85096709

联系人：潘锴

客户服务电话：4006000686，（0431）85096733

网址：www.nesc.cn

(28) 中航证券有限公司

住所：南昌市抚河北路 291 号

办公地址：南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：杜航

电话：（0791）6768763

传真：（0791）6789414

联系人：余雅娜

客户服务电话：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

(29) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

电话：(0755) 82558305

传真：(0755) 82558355

联系人：陈剑虹

客户服务电话：400-800-1001

网址：www.axzq.com.cn

(30) 宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市建设路 2 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号宏源证券

法定代表人：冯戎

电话：(010) 88085858

传真：(010) 88085195

联系人：李巍

客户服务电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

(31) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：(027) 65799999

传真：(027) 85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

(32) 德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：姚文平

电话：(021) 68761616

传真：(021) 68767981

客户服务电话：4008-888-128

网址：www.tebon.com.cn

(33) 齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

(34) 江海证券有限公司

住所：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

电话：(0451) 82336863

传真：(0451) 82287211

联系人：张宇宏

客户服务电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

(35) 平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

法定代表人：杨宇翔

电话：(0755) 22627802

传真：(0755) 82433794

联系人：袁月

客户服务电话：95511，400-886-6338

网址：www.pingan.com

(36) 厦门证券有限公司

住所：厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼

办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼

法定代表人：傅毅辉

电话：(0592) 5161642

传真：(0592) 5161640

联系人：卢金文

客户服务电话：(0592) 5163588

网址：www.xmzq.cn

(37) 中国国际金融有限公司

住所：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：李剑阁

网址：www.cicc.com.cn

(38) 瑞银证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：刘弘

电话：(010) 59226788

传真：(010) 59226840

联系人：谢亚凡、田文健

客户服务电话：400-887-8827

网址：www.ubssecurities.com

(39) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市南京西路758号24楼

办公地址：上海市南京西路758号24楼

法定代表人：张建华

电话：（021）32229888

联系人：陈敏

客户服务电话：（021）63340678

网址：www.ajzq.com

（40） 长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

电话：（0755）83516289

传真：（0755）83516199

联系人：匡婷

客户服务电话：（0755）33680000，400-6666-888

网址：www.cc168.com.cn

（41） 中国民族证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人：赵大建

客户服务电话：400-889-5618

网址：www.e5618.com

（42） 国金证券股份有限公司

住所：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：（028）86690126

传真：（028）86690126

联系人：金喆

客户服务电话：400-6600-109

网址：www.gjzq.com.cn

(43) 方正证券股份有限公司

住所：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

电话：(0731)85832343

传真：(0731)85832342

联系人：彭博

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

(44) 渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

电话：(022) 28451861

传真：(022) 28451892

联系人：王兆权

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.bhzq.com

(45) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

电话：(010) 63081000

传真：(010) 63080978

联系人：唐静

客户服务电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

(46) 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：王益民

电话：(021) 63325888

传真：(021) 63326173

联系人：吴宇

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

(47) 华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人：李晓安

电话：(0931) 4890100

传真：(0931) 4890118

联系人：李昕田

客户服务电话：(0931) 4890100、4890619、4890618

网址：www.hlzqgs.com

(48) 东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：徐勇力

电话：(010) 66555316

传真：(010) 66555246

联系人：汤漫川

客户服务电话：400-8888-993

网址：www.dxzq.net.cn

(49) 华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州五四路新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

电话：（0591）87841160

传真：（0591）87841150

客户服务电话：（0591）96326

网址：www.gfhfzq.com.cn

（50） 华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区月坛北街 26 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座三层

法定代表人：丁之锁

电话：（010）58568007

传真：（010）58568062

联系人：梁宇

客户服务电话：（010）58568118

网址：www.hrsec.com.cn

（51） 中原证券股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号中原广发金融大厦 17 层

法定代表人：石保上

电话：（0371）65585670

传真：（0371）65585665

联系人：程月艳、耿铭

客户服务电话：（0371）967218，400-813-9666

网址：www.ccnew.com

（52） 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

电话：（010）66045566

传真：（010）66045500

联系人：林爽

客户服务电话：（010）66045678

网址：www.txsec.com，https://jijin.txsec.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：（010）59378839

传真：（010）59378907

联系人：朱立元

（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：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：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

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：金毅

经办注册会计师：薛竞、金毅

四、基金的名称

本基金名称：交银施罗德信用添利债券证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型。本基金在基金合同生效之日起三年（含三年）的期间内，采取封闭式运作（按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外），在深圳证券交易所上市交易，封闭期结束后转为上市开放式基金（LOF）。

六、基金的投资目标

本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势，自上而下进行宏观分析，自下而上精选个券，在控制信用风险、利率风险和流动性风险前提下，力求通过主动承担适度信用风险获得持续投资收益，谋求基金资产的长期稳定增长。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于固定收益类资产，包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券及可分离转债、资产支持证券、次级债和债券回购等金融工具。本基金可同时投资于股票、权证等权益类产品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。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类金融工具，但可以参与一级市场股票首次公开发行或新股增发，并可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于分离交易可转债而产生的权证。

本基金的投资组合比例如下：

本基金在封闭期内，对债券等固定收益类资产的投资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固定收益类资产的80%；对股票、权证等非

固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%。

本基金在开放期内，对债券等固定收益类资产的投资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固定收益类资产的 80%；对股票、权证等非固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%；其中现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金所指信用债券指金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券及可分离转债、资产支持证券等除国债和中央银行票据之外的、非国家信用的固定收益类金融工具。

如法律法规或中国证监会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

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期及债券类属配置；在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选个券。

同时，本基金也会关注股票一级市场、权证一级市场等其它相关市场存在的投资机会，力争实现基金总体风险收益特征保持不变前提下的基金资产增值最大化。

1、大类资产配置

本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合，形成对不同大类资产市场的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定债券类资产、权益类资产和现金的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。

2、债券投资策略

（1）久期管理策略

作为债券基金最基本的投资策略，久期管理策略在本质上是一种自上而下的，

通过合理的久期控制实现对利率风险有效管理的策略。

在全球经济的框架下，本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化做出判断，密切跟踪 CPI、PPI、汇率、M2 等利率敏感指标，运用数量化工具，对未来市场利率趋势进行分析与预测，并据此确定合理的债券组合目标久期。具体而言，当预期市场利率下降时，本基金将拉长所持有债券组合的久期，以获得市场利率实际下降时债券价格上涨的收益；反之，当预期市场利率上升时，则缩短组合久期，以规避债券价格下降带来的资本损失。

（2）债券的类属配置

本基金定性和定量地分析不同类属债券类资产的信用风险、流动性风险及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力，通过比较或合理预期不同类属债券类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整不同类属债券类资产间的配置比例。

具体而言，本基金是在控制信用风险和流动性风险为主的基金总体风险水平的前提下，通过灵活运用类属配置策略合理优化配置基金资产，通过对信用风险和流动性风险的有效管理，谋求更高的经风险调整后的稳定收益。

（3）收益率曲线配置策略

本基金将通过预期收益率曲线形态变化来调整投资组合的头寸。

在考察收益率曲线的基础上，本基金将确定采用子弹策略、哑铃策略或梯形策略等，以从收益率曲线的形变中获利。一般而言，当收益率曲线变陡时，将采用子弹策略；当收益率曲线变平时，将采用哑铃策略；在预期收益率曲线不变或平行移动时，则采用梯形策略。

（4）杠杆放大策略

当回购利率低于债券收益率时，本基金将实施正回购融入资金并投资于信用债券等可投资标的，从而获取收益率超出回购资金成本（即回购利率）的套利价值。

（5）信用债券投资策略

信用债券投资策略是本基金最重要的投资策略。信用债券同时承载了利率风险与信用风险，而信用风险对信用债券表现的影响胜于利率风险。

具体而言，本基金信用债券的投资遵循以下流程：

①信用债券研究

信用分析师通过系统的案头研究、走访发行主体、咨询发行中介等各种形式，“自上而下”地分析宏观经济运行趋势、行业（或产业）经济前景，“自下而上”地分析发行主体的发展前景、偿债能力、国家信用支撑等。通过交银施罗德的信用债券信用评级指标体系，对信用债券进行信用评级，并在信用评级的基础上，建立本基金的信用债券池。

②信用债券投资

基金经理从信用债券池中精选债券构建信用债券投资组合。本基金构建和管理信用债券投资组合时主要考虑以下因素：

a. 信用债券信用等级的变化。

b. 不同信用等级的信用债券，以及同一信用等级不同标的债券之间的信用利差变化。

（6）资产支持证券（含资产收益计划）投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构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；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、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（7）可转换债券投资策略

可转换债券是介于股票和债券之间的投资品种，兼具股性和债性的双重特征。本基金对于可转换债券股性的研究将完全依托于公司投研团队对标的股票的研究，在此基础上金融工程部利用可转换债券定价模型，充分考虑转债发行后目标转债标的股票股价波动率可能出现的变化，对目标转债的股性进行合理定价。

对于本基金可转换债券债性的研究，将引进公司信用债券信用评级指标体系，对可转换债券的发行主体及标的债券进行信用评级，并在信用评级的基础上对其进行合理定价。

通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求寻找出被市场低估的品种，构建本基金可转换债券的投资组合。

3、新股投资策略

本基金将通过分析影响股票一级市场资金面的相关市场风险收益特征的变化、股票发行政策取向（如扩容节奏、发行市盈率与二级市场市盈率的差距），预测新股一级市场供求关系的变化，并据此进一步预测新股中签率和新股的收益率变动趋势；同时，借助公司投资平台行业研究员的研究建议，预测拟申购新股的中签率和收益率，确定合理规模的资金后精选个股进行申购，并于其可上市交易或流通受限解除后，在控制组合波动性风险的前提下根据对市场和个股的判断选择合适的时机出售，以期提升基金的收益水平。

4、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征以选择权证的卖出时机，追求稳定的当期收益。

九、基金的业绩比较标准

本基金的整体业绩比较基准为：

中债企业债总全价指数收益率×80%+中债国债总全价指数收益率×20%

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数，则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后，调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金是一只债券型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种，其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

十一、基金投资组合报告

本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。

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于2011年7月19日复核了本

报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容, 保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期为 2011 年 4 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日。本报告财务资料未经审计师审计。

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	75,390,000.00	2.92
	其中：股票	75,390,000.00	2.92
2	固定收益投资	2,444,411,729.81	94.60
	其中：债券	2,444,411,729.81	94.60
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	21,525,928.46	0.83
6	其他各项资产	42,615,668.83	1.65
7	合计	2,583,943,327.10	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-

C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	75,390,000.00	3.89
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	75,390,000.00	3.89

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	000783	长江证券	7,000,000	75,390,000.00	3.89

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	237,654,000.00	12.25

	其中：政策性金融债	237,654,000.00	12.25
4	企业债券	1,810,772,911.80	93.32
5	企业短期融资券	60,066,000.00	3.10
6	中期票据	-	-
7	可转债	335,918,818.01	17.31
8	其他	-	-
9	合计	2,444,411,729.81	125.98

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	122840	11临汾债	1,500,000	157,185,000.00	8.10
2	122836	11盘锦债	1,000,000	103,020,000.00	5.31
3	122875	10红投02	1,000,000	102,490,000.00	5.28
4	1180032	11鹰投债	1,000,000	100,530,000.00	5.18
5	1180014	11新乡投资债	1,000,000	100,400,000.00	5.17

6、本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

(2) 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,640.60
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	42,569,684.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,343.84
8	其他	-
9	合计	42,615,668.83

(4) 本基金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	113002	工行转债	84,657,477.30	4.36
2	113001	中行转债	67,571,200.00	3.48
3	126729	燕京转债	13,381,452.45	0.69
4	125731	美丰转债	11,772,600.00	0.61

(5) 本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2011 年 6 月 30 日，所载财务数据未经审计师审计。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

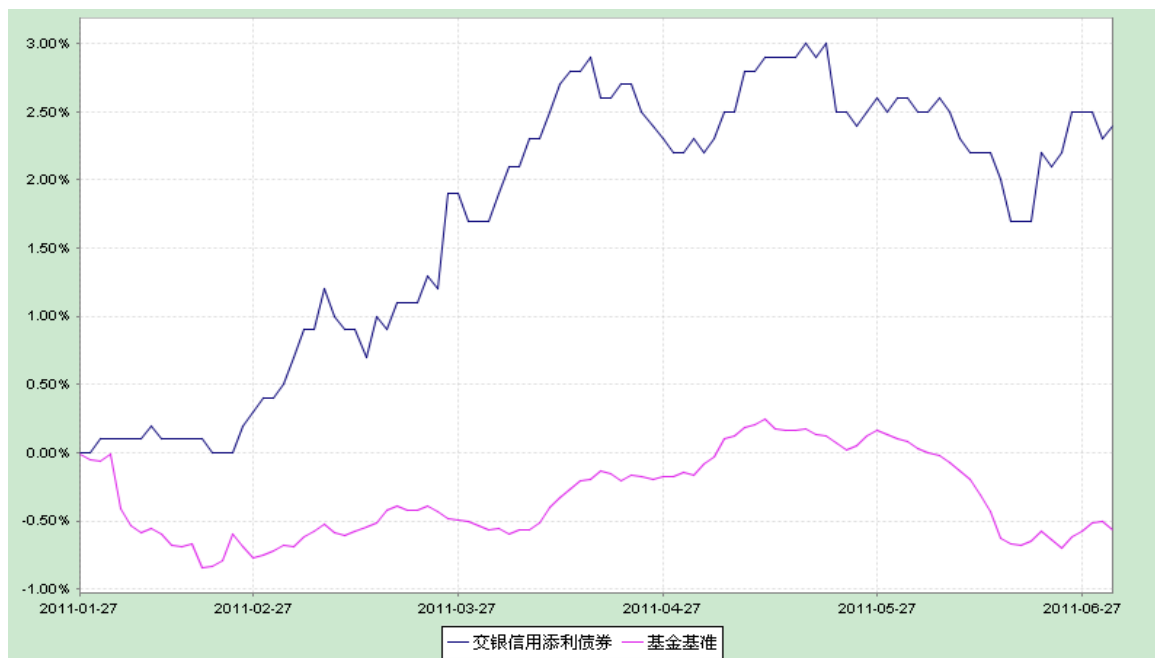
过去三个月	0.69%	0.15%	0.01%	0.06%	0.68%	0.09%
自基金合同生效起至今	2.40%	0.16%	-0.56%	0.07%	2.96%	0.09%

2、自基金合同生效以来基金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

交银施罗德信用添利债券证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2011年1月27日至2011年6月30日）



注：本基金基金合同生效日为2011年1月27日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2011年6月30日，本基金尚处于建仓期。

十三、基金的费用与税收

（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、基金合同生效后的信息披露费用；
- 4、基金份额持有人大会费用；

- 5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金上市费用；
- 8、证券账户开户费用和银行账户维护费；
- 9、基金财产划拨支付的银行费用；
- 10、按照国家有关规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、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 0.6\%$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年托管费率为 } 0.2\%$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（3）上述（一）中 3 到 9 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内，采取封闭式运作（按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外），在深圳证券交易所上市交易。封闭期内，基金投资者不能申购、赎回本基金基金份额。基金封闭期结束，本基金转为上市开放式基金(LOF)后，基金投资者方可申购赎回本基金基金份额。

(1) 申购费

本基金的场外申购提供两种申购费用的支付模式。投资者可以选择前端收费模式，即在申购时支付申购费用；也可以选择后端收费模式，即在赎回时才支付相应的申购费用，该费用随基金份额的持有时间递减。场外申购后端收费模式下的基金份额不能转托管至场内进行上市交易。

本基金的场内申购只能选择前端收费模式支付申购费用。

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下：

	申购金额（含申购费）	前端申购费率
场内、场外前端申购费率	50 万元以下	0.8%
	50 万元（含）至 100 万元	0.6%
	100 万元（含）至 200 万元	0.5%
	200 万元（含）至 500 万元	0.3%
	500 万元（含）以上	每笔交易 1000 元

	持有期限	后端申购费率
场外后端申购费率	1 年以内（含）	1.0%
	1 年—3 年（含）	0.6%
	3 年—5 年（含）	0.4%
	5 年以上	0

因红利自动再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。

（2）申购份额的计算

前端收费模式：

申购总金额=申请总金额

净申购金额=申购总金额/（1+申购费率）

（注：对于适用固定金额申购费用的申购，净申购金额=申购总金额-固定申购费用金额）

申购费用=申购总金额-净申购金额

（注：对于适用固定金额申购费用的申购，申购费用=固定申购费用金额）

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

场内申购的有效份额保留到整数位，剩余部分对应申购资金返还至投资人。场内申购对应返还申购金额=申购总金额-实际净申购金额-申购费用，其中实际净申购金额=取整数位后确认的申购份额×T 日基金份额净值。

例三：某投资者投资 100,000 元申购本基金（非网上交易），假设申购当日基金份额净值为 1.040 元，如果其选择前端收费方式，申购费率为 0.8%，如果该投资者是场外申购，则其可得到的申购份额为：

申购总金额=100,000 元

净申购金额=100,000/（1+0.8%）=99,206.35 元

申购费用=100,000-99,206.35=793.65 元

申购份额=99,206.35/1.040=95,390.72 份

如果该投资者是场内申购，申购份额为 95,390 份，则：

实际净申购金额=95,390×1.040=99,205.60

对应返还申购金额=100,000-99,205.60-793.65=0.75 元

即：投资者投资 100,000 元申购本基金前端份额，假设申购当日基金份额净值为 1.040 元，如是场外申购，则可得到 95,390.72 份基金份额，如是场内申购，则可得 95,390 份基金份额，同时被返还 0.75 元申购资金。

后端收费模式：

申购总金额=申请总金额

申购份额=申购总金额/T 日基金份额净值

当投资者提出赎回时，后端申购费用的计算方法为：

后端申购费用=赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率

例四：某投资者投资 100,000 元场外申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.040 元，如果其选择后端收费方式，则其可得到的申购份额为：

申购份额=100,000/1.040=96,153.85 份

即：投资者投资 100,000 元场外申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.040 元，则可得到 96,153.85 份基金份额，但其在赎回时需根据其持有时间按对应的后端申购费率交纳后端申购费用。

（3）赎回费用

赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用的 25%归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本基金的赎回费率如下：

	持有期限	赎回费率
场外赎回费率	1 年以内（含）	0.1%
	1 年—2 年（含）	0.05%
	2 年以上	0
场内赎回费率	本基金场内赎回费率为固定值 0.1%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。	

其中，通过场外认购或场外申购获得的基金份额其持有年限以基金份额实际持有年限为准；通过场内认购、场内申购以及场内买入获得基金份额被转托管至场外并赎回的，其基金份额持有年限自该基金份额转托管至场外之日起开始计算。

（4）赎回金额的计算

投资者认购及选择前端方式申购的基金份额，其赎回金额的计算方法如下：

赎回费用=赎回份额×T 日基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T 日基金份额净值-赎回费用

例五：某投资者赎回通过前端申购持有的 100,000 份基金份额，对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用=100,000×1.016×0.1%=101.60 元

赎回金额=100,000×1.016-101.60=101,498.40 元

即：投资者赎回本基金 100,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为 101,498.40 元。

如果投资者在申购时选择交纳后端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份额×T 日基金份额净值

后端申购费用=赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-后端申购费用-赎回费用

例六：某投资者赎回通过后端申购持有的 100,000 份基金份额，对应的后端申购费率是 1.0%，赎回费率为 0.1%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，申购时的基金份额净值为 1.010 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=100,000×1.016=101,600 元

后端申购费用=100,000×1.010×1.0%=1,010.00 元

赎回费用=101,600×0.1%=101.60 元

赎回金额=101,600-1,010.00-101.60=100,488.40 元

即：投资者赎回本基金 100,000 份基金份额，对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，投资者对应的后端申购费率是 1.0%，申购时的基金净值为 1.010 元，则其可得到的赎回金额为 100,488.40 元。

(5) 基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人应于新的费率或收费方式实施日前依照有关规定在指定媒体上公告。

(6) 对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人在履行适当程序后可以采用低于柜台交易方式的基金前端申购费率。

(7) 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调低基金申购费率。

（8）在法律法规和基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，可由基金管理人和基金托管人协商，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式，报中国证监会备案后修改基金合同并及时公告，但不需召开基金份额持有人大会。

（三）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。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（四）基金管理费和托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体上刊登公告。

（五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

总体更新

本次更新招募说明书更新了“重要提示”、“基金管理人”、“基金托管人”、“相关服务机构”、“基金的募集”、“基金合同的生效”、“基金份额的上市交易”、“基金份额的申购和赎回”、“基金的投资”、“基金的业绩”、“对基金份额持有人的服务”以及“其他应披露事项”等部分的内容。

“重要提示”部分

增加了本招募说明书所载相关内容截止日；增加本基金基金合同成立生效日期。

“三、基金管理人”部分

1、“（一）基金管理人概况”

更新了公司旗下基金和人员情况。

2、“（二）主要成员情况”

“1、基金管理人董事会成员”

更新董事会成员名单及相关信息

“2、基金管理人监事会成员”

更新监事会成员名单。

“3、公司高管人员”

更新公司高管人员名单及相关信息。

“4、本基金基金经理”

更新本基金基金经理相关信息。

“5、投资决策委员会成员”

更新投资决策委员会成员名单及相关成员职务信息。

“四、基金托管人” 部分

更新了基金托管人基本情况及基金托管业务经营情况等内容。

“五、相关服务机构” 部分

1、“（一）基金份额销售机构”

“1、直销机构”

更新相关信息。

“3、场外代销机构”

增加及更新代销机构相关信息。

2、“（二）基金注册登记机构”

更新基金注册登记机构相关信息。

3、“（四）审计基金财产的会计师事务所”

更新审计基金财产的会计师事务所的住所信息。

“六、基金的募集” 部分

删除关于基金认购的相关内容；增加基金的实际募集情况。

“七、基金合同的生效” 部分

删除基金备案条件和基金合同不能生效时募集资金的处理方式等；增加基金合同生效的生效日期。

“八、基金份额的上市交易”部分

合并了“（一）基金的上市”和“（二）上市交易的时间和地点”，删除基金的上市条件，增加的基金上市的时间、地点及其他相关信息。

“九、基金份额的申购和赎回”部分

1、“（二）申购和赎回的场所”

更新相关信息。

2、“（十五）转托管”

更新相关内容。

“十一、基金的投资”部分

增加“（十三）基金投资组合报告”。数据截止到2011年6月30日。

增加“十二、基金的业绩”部分

增加基金的业绩，数据截止到2011年6月30日。

“二十三、对基金份额持有人的服务”部分

更新相关表述。

“二十四、其他应披露事项”部分

更新了本次招募说明书更新期间，涉及本基金的相关信息披露。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一一年九月九日