



交银施罗德货币市场证券投资基金 (更新) 招募说明书摘要

(2012 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

【重要提示】

交银施罗德货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2005 年 12 月 21 日中国证券监督管理委员会证监基金字【2005】204 号文核准募集。本基金基金合同于 2006 年 1 月 20 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、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金管理人不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资人在认（申）购本基金前应认真阅读本招募说明书。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《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 2012 年 1 月 20 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 12 月 31 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

成立日期：2005年8月4日

注册资本：贰亿元人民币

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%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的合法权益。公司董事会下设合规审核及风险管理委员会、提名与薪酬委员会两个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由三位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司总体经营由总经理负责，下设风险控制委员会和投资决策委员会两个专业委员会，其中投资决策委员会包括公募基金（除 QDII）投资决策委员会、QDII 投资决策委员会和专户投资决策委员会。公司设督察长，监督检查基金和公司运作的合法合规及公司内部风险控制情况。投资研究条线下设权益部、固定收益部、专户投资部、研究部、量化投资部、跨境投资部。中央交易室隶属总经理直接管理。市场条线下设产品开发部、营销策划部、零售理财部、营销管理部、机构理财部、上海营销中心、北京分公司、广州分公司、西南营销中心。营运条线下设财务部、基金运营部与信息技术部。综合管理条线下设人力资源部和行政部。监察稽核条线下设监察稽核部、风险管理部、法务部，由督察长协同总经理直接管理。此外，根

据业务需要，增设了战略发展部。本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。投资管理流程中，基金经理、研究员、交易员在明确权责的基础上密切合作，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。

截止到2011年四季度末，公司已经发行并管理了18只基金，包括1只货币市场基金、3只债券型基金、1只保本混合型基金、2只混合型基金、11只股票型基金，其中1只为QDII基金，2只为交易型开放式基金（ETF），2只为ETF联接基金。

截止到2011年12月31日，公司有员工192人，其中53%的员工具有硕士以上学历。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度。

（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。

谢丹阳先生，独立董事，博士学历。历任蒙特利尔大学经济系助理教授，国际货币基金经济学家和高级经济学家，香港科技大学助理教授、副教授、教授、系主任，现任香港科技大学教授、瑞安经管中心主任。

袁志刚先生，独立董事，博士学历。历任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任，现任复旦大学经济学院院长。

周林先生，独立董事，博士学历。历任复旦大学管理科学系助教，美国耶鲁大学经济系助理教授、副教授，美国杜克大学经济系副教授，香港城市大学经济与金融系教授，美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院经济系冠名教授，上海交通大学上海高级金融学院常务副院长、教授，现任上海交通大学安泰经济与管理学院院长、教授。

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、交银施罗德基金管理有限公司监察稽核及风险管理总监。现任交银施罗德基金管理有限公司总经理助理。

陈超女士，监事，硕士学历。历任交通银行股份有限公司资产托管部内控综合员，交银施罗德基金管理有限公司董事会秘书、合规审计部总经理，现任交银施罗德基金管理有限公司监察稽核部总经理兼董事会秘书。

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。8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日起担任交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金经理至今。2011年6月9日起兼任本基金基金经理至今。

历任基金经理：

陈晓秋女士，2006年1月20日至2009年10月30日担任本基金基金经理。

李家春先生，2006年12月27日至2011年6月8日担任本基金基金经理。

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（权益部副总经理、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 余名，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2012年1月20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116只，包括交银施罗德货币市场证券投资基金、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、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、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、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、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、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、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、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元比联保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金。

（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

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、申购、赎回、转换及定期定额投资等业务，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、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

电话：（010）85108227

传真：（010）85109219

联系人：滕涛

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

（2）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街55号

办公地址：北京市复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

电话：（010）66107900

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（3）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

电话：（010）66275654

传真：（010）66275654

联系人：王琳

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

（4）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

（5）招商银行股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

电话：（0755）83198888

传真：（0755）83195109

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（6）广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

联系人：李晓鹏

客户服务电话：800-830-8003，400-830-8003

网址：www.gdb.com.cn

(7) 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

(8) 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

(9) 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

(10) 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

(11) 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

(12) 江苏银行股份有限公司

住所：南京市洪武北路 55 号

办公地址：南京市洪武北路 55 号

法定代表人：黄志伟

电话：(025) 58587018

传真：(025) 58587038

联系人：田春慧

客户服务电话：96098，40086-96098

网址：www.jsbchina.cn

(13) 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

（14）杭州银行股份有限公司

住所：杭州市庆春路46号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

电话：（0571）85108309

传真：（0571）85151339

联系人：严峻

客户服务电话：（0571）96523，400-8888-508

网址：www.hzbank.com.cn

（15）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

（16）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：万建华

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

（17）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：张佑君

电话：（010）85130588

传真：（010）65182261

联系人：魏明

客户服务电话：4008-888-108

网址：www.csc108.com

（18）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

（19）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

（20）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）66568430

联系人：田薇

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

（21）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

（22）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

（23）中信证券股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：（010）60838888

传真：（010）60833739

联系人：陈忠

客户服务电话：95558

网址：www.cs.ecitic.com

（24）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：李清怡

客户服务电话：95523 或 4008895523

网址：www.sywg.com

（25）湘财证券有限责任公司

住所：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼

法定代表人：林俊波

电话：（021）68634518

传真：（021）68865680

联系人：钟康莺

客户服务电话：400-888-1551

网址：www.xcsc.com

（26）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

（27）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）83290979

传真：（025）51863323

联系人：程高峰、万鸣

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

（28）中信证券（浙江）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

（29）中银国际证券有限责任公司

住所：上海市浦东银城中路200号39层

办公地址：中国上海浦东银城中路200号中银大厦39-40层

法定代表人：许刚

联系人：李丹

客户服务电话：400-620-8888

网址：www.bocichina.com

（30）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

（31）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

（32）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1012号国信证券大厦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

（33）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

（34）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

（35）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）6768681

传真：（0791）6789414

联系人：余雅娜

客户服务电话：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

（36）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.essence.com.cn

（37）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

（38）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

（39）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

（40）齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李玮

电话：（0531）68889155

传真：（0531）68889752

联系人：吴阳

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（41）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) 82269280

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

(42) 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(518048)

法定代表人：杨宇翔

传真：(0755) 82400862

联系人：郑舒丽

客户服务电话：95511-8

网址：www.pingan.com

(43) 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

(44) 华宝证券有限责任公司

住所：中国上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 楼

办公地址：中国上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 楼

法定代表人：陈林

电话：(021) 50122107

传真：(021) 50122078

联系人：楼斯佳

客户服务电话：(021) 38929908

网址：www.cnhbstock.com

(45) 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

(46) 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

(47) 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

(48) 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

（49）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

（50）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.gjqz.com.cn

（51）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

（52）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

（53）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：高冠江

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

（54）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

（55）西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：王珠林

电话：（023）63786464

传真：（023）63786311

联系人：陈诚

客户服务电话：400-809-6096

网址：www.swsc.com.cn

（56）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

（57）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

（58）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：福州市五四路新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

电话：（0591）87383623

传真：（0591）87383610

客户服务电话：（0591）96326

网址：www.hfzq.com.cn

（59）中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

电话：（0755）82023442

传真：（0755）82026539

联系人：刘毅

客户服务电话：400-600-8008

网址：www.china-invs.cn

（60）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

（61）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

（62）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或变更上述代销机构，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：上海源泰律师事务所

住所：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室

办公地址：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：廖海

经办律师：梁丽金、刘佳

（四） 审计基金财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所有限公司

住所：上海市延安东路 222 号 30 楼

办公地址：上海市延安东路 222 号 30 楼

法定代表人：郑树成

电话：(021) 61418888

传真：(021) 63350177

联系人：陶坚

经办注册会计师：陶坚、刘明华

四、基金的名称

本基金名称：交银施罗德货币市场证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金属于货币市场基金，投资目标是在力求本金稳妥和资产充分流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于货币市场工具，包括：

- 1、现金；
- 2、通知存款；

- 3、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；
- 4、剩余期限在397天以内（含397天）的债券；
- 5、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；
- 6、期限在一年以内（含一年）的债券回购；
- 7、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券；
- 8、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。

八、基金的投资策略

（一）短期利率水平预期策略

深入分析国家货币政策、短期资金市场利率波动、资本市场资金面的情况和流动性的变化，对短期利率走势形成合理预期，并据此调整基金货币资产的配置策略。

（二）收益率曲线分析策略

根据收益率曲线的变化趋势，采取相应的投资管理策略。货币市场收益率曲线的形状反映当时短期利率水平之间的关系，反映市场对较短期限经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。

（三）组合剩余期限策略、期限配置策略

通过对组合资产剩余期限的设计、跟踪、调整，达到保持合理的现金流，锁定组合剩余期限，以满足可能的、突发的现金需求，同时保持组合的稳定收益；特别在债券投资中，根据收益率曲线的情况，投资一定剩余期限的品种，稳定收益，锁定风险，满足组合目标期限。

（四）类别品种配置策略

在保持组合资产相对稳定的条件下，根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

（五）流动性管理策略

在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下，通过基金资产安排（包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他措施），在保持基金资产高流动性的前

提下，确保基金的稳定收益。

（六）无风险套利策略

无风险套利策略包括：

跨市场套利策略：根据各细分短期金融工具的流动性和收益特征，动态调整基金资产在各个细分市场之间的配置比例。如，当交易所市场回购利率高于银行间市场回购利率时，可增加交易所市场回购的配置比例；另外，还包括一级市场发行定价和二级市场流通成交价之间的无风险套利机会。

跨品种套利策略：根据各细分市场中不同品种的风险参数、流动性补偿和收益特征，动态调整不同期限结构品种的配置比例。

（七）滚动配置策略

根据具体投资品种的市场特性，采用持续滚动投资的方法，以提高基金资产的整体持续的变现能力。如，对N天期回购协议进行每天等量配置，提高基金资产的流动性；在公开市场操作中，跟随人民银行每周的滚动发行，持续同品种投资，达到剩余期限的直线分布。

（八）信用利差策略

通过对资产支持证券的信用评估，分析预期违约率和违约损失率的变化趋势，评估其信用利差是否合理，并预测其变化趋势，通过其信用质量的改善和信用利差的缩小获利。

九、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准为六个月银行定期存款利率（税后）。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用，基金管理人可根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。

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2012年1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。

本投资组合报告期为2011年10月1日至2011年12月31日，所载财务数据未经审计师审计。

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	固定收益投资	1,490,493,259.32	17.64
	其中：债券	1,490,493,259.32	17.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,312,919,089.38	39.20
	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	3,609,995,235.58	42.71
4	其他各项资产	38,345,443.41	0.45
5	合计	8,451,753,027.69	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余 额	4.17	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	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：①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银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

②报告期内本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

(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	39
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	169
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

(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	81.36	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	1.19	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	2.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	5.36	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.47	-
5	180天(含)—397天（含）	9.54	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

	合计	100.32	-
--	----	--------	---

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	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	319,998,924.67	3.82
3	金融债券	169,720,703.45	2.02
	其中：政策性金融债	169,720,703.45	2.02
4	企业债券	39,068,930.77	0.47
5	企业短期融资券	912,164,606.77	10.88
6	中期票据	49,540,093.66	0.59
7	其他	-	-
8	合计	1,490,493,259.32	17.77
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	39,068,930.77	0.47

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	1101094	11央行票据94	1,500,000	145,251,366.92	1.73
2	1181071	11北医药CP01	1,000,000	100,415,781.89	1.20
3	1181219	11中铝CP01	1,000,000	100,219,150.53	1.19
4	090217	09国开17	1,000,000	99,443,249.47	1.19
5	1101088	11央行票据88	1,000,000	97,052,950.84	1.16
6	1181317	11中铝CP02	800,000	80,380,801.79	0.96
7	1101086	11央行票据86	800,000	77,694,606.91	0.93

8	1181081	11美克CP01	700,000	70,348,409.75	0.84
9	1181182	11红豆CP01	600,000	59,987,233.23	0.72
10	0411560 09	11开滦 CP001	500,000	50,152,459.01	0.60

6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1494%
报告期内偏离度的最低值	-0.1534%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0558%

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8、投资组合报告附注

（1）基金计价方法说明。

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与折价，在其剩余期限内按照实际利率和摊余成本逐日摊销计算损益。

（2）本基金报告期每日持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本均未超过当日基金资产净值的 20%。

（3）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。

（4）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	38,345,443.41
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	38,345,443.41

(5) 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 12 月 31 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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

	阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
A 级	过去三个月	0.9871%	0.0027%	0.8318%	0.0000%	0.1553%	0.0027%
	2011 年度	3.2554%	0.0036%	3.0748%	0.0007%	0.1806%	0.0029%
	2010 年度	1.5968%	0.0023%	2.0289%	0.0003%	-0.4321%	0.0020%
	2009 年度	1.3396%	0.0049%	1.9800%	0.0000%	-0.6404%	0.0049%
	2008 年度	3.3151%	0.0083%	3.4340%	0.0011%	-0.1189%	0.0072%
	2007 年度	3.2219%	0.0063%	2.4441%	0.0017%	0.7778%	0.0046%
	2006 年度	1.6718%	0.0022%	1.6231%	0.0002%	0.0487%	0.0020%

	（自基金合同生效日至2006年12月31日）						
B级	过去三个月	1.0463%	0.0027%	0.8318%	0.0000%	0.2145%	0.0027%
	2011年度	3.5014%	0.0036%	3.0748%	0.0007%	0.4266%	0.0029%
	2010年度	1.8421%	0.0023%	2.0289%	0.0003%	-0.1868%	0.0020%
	2009年度	1.5829%	0.0048%	1.9800%	0.0000%	-0.3971%	0.0048%
	2008年度	3.5615%	0.0083%	3.4340%	0.0011%	0.1275%	0.0072%
	2007年度（自基金分级日起至2007年12月31日）	2.1597%	0.0080%	1.5446%	0.0013%	0.6151%	0.0067%

注：本基金收益分配按月结转份额。

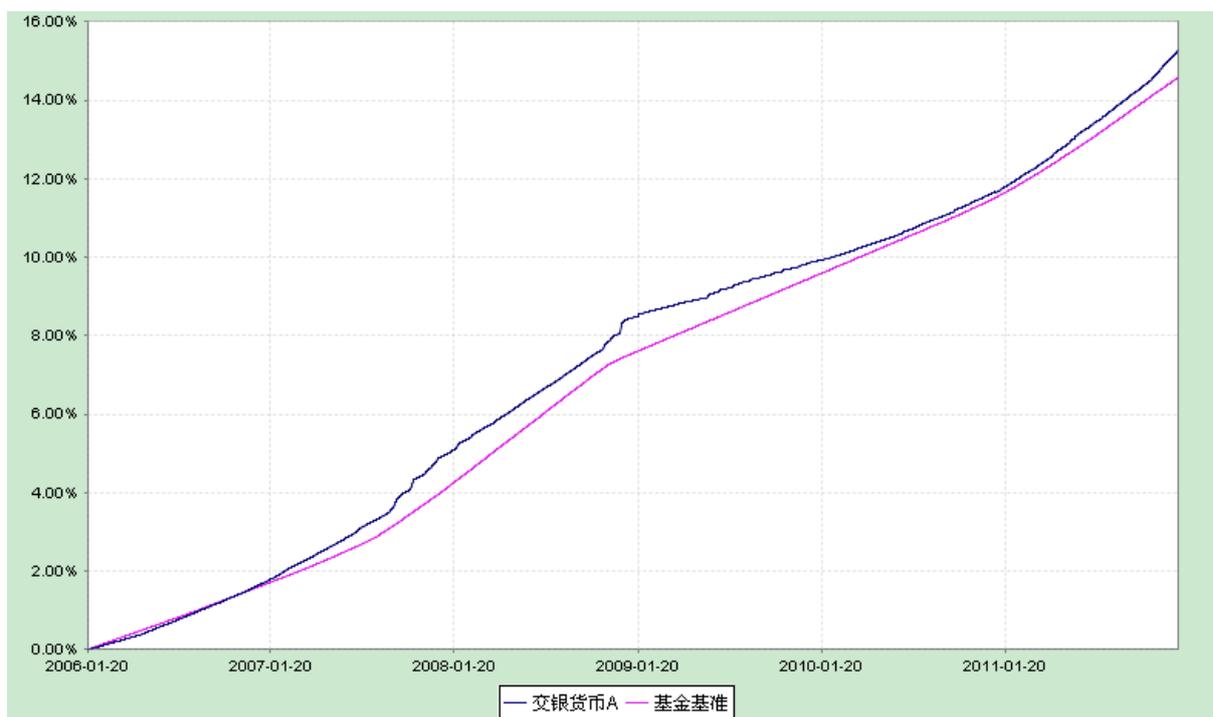
（二）自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德货币市场证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

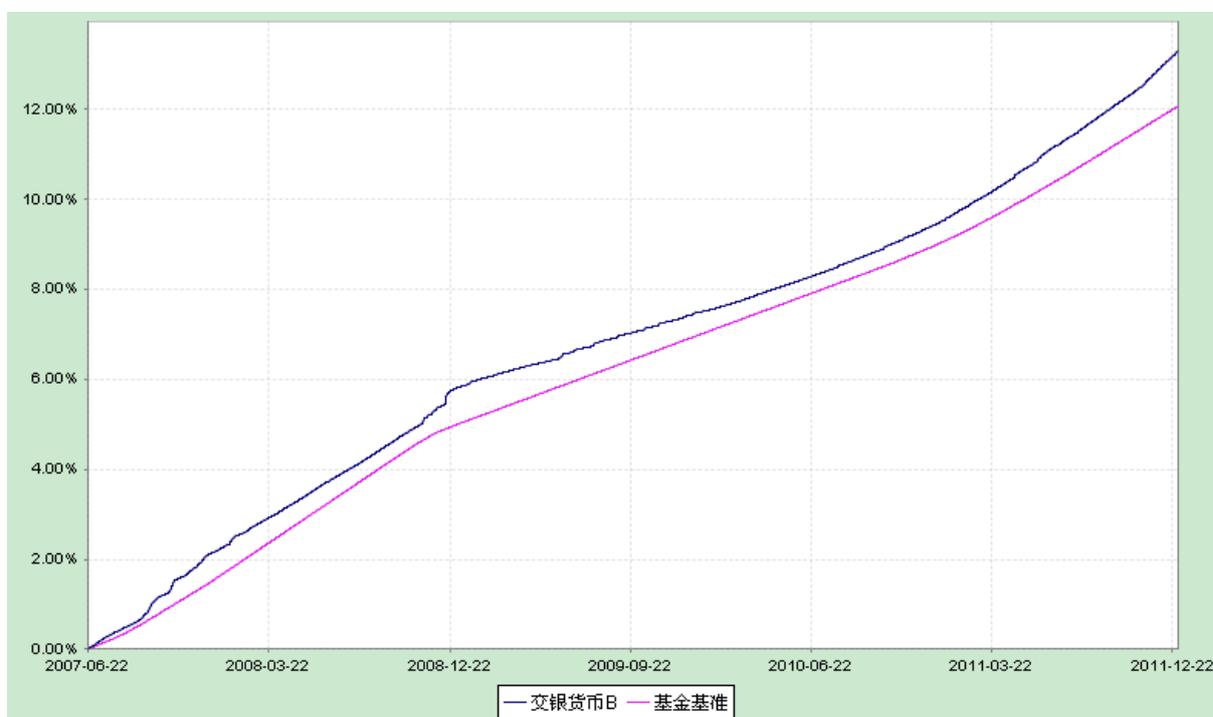
（2006年1月20日至2011年12月31日）

1、交银货币 A



注：图示日期为2006年1月20日至2011年12月31日。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束及本报告期末，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、交银货币 B



注：图示日期为2007年6月22日至2011年12月31日。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束及本报告期末，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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、基金销售服务费；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、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。

本基金基金合同终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（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

本基金的管理费按基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应付的基金管理费

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款指令，基金托管人复核后于次月前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、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2. 与基金销售有关的费用

(1) 申购费

本基金申购费的费率为零。

申购份额的计算如下：

申购总金额=申请总金额

申购份额=申购金额÷基金份额净值

例一：假定 T 日某投资人投资 10,000 元申购本基金，则其可得到的申购份额计算如下：

申购份额=10,000/1.00=10,000 份

申购份数保留至小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，四舍五入部分所代表的资产归基金所有。

(2) 赎回费

本基金赎回费的费率为零。

基金赎回金额的计算如下：

赎回金额=赎回份额×基金份额净值+该份额对应的未付收益

例二：假定某投资人在 T 日赎回 10,000 份本基金，且假设该 10,000 份基金份额对应的未支付收益为 15.00 元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000×1.00+15.00=10,015.00 元

赎回总额以人民币元为单位，保留至小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，四舍五入部分所代表的资产归基金所有。

(3) 转换费

1) 每笔基金转换视为一笔赎回和一笔申购，基金转换费用相应由转出基金的赎回费用及转出与转入基金的申购补差费用构成。

2) 转出基金的赎回费用

转出交银货币、交银增利 C 类基金份额或交银双利 C 类基金份额不收取赎回费用；转出交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银保本、交银制造、交银价值、交银增利 A 类、B 类基金份额和交银双利 A 类、B 类基金份额收取赎回费用，赎回费用的 25% 归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费，上述转出基金的赎回费率具体如下：

转出基金	转出份额持有时间	赎回费率
交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值	1 年（含）以内	0.5%
	1 年-2 年（含）	0.2%
	2 年以上	0
交银增利 A 类、B 类基金份额	1 年（含）以内	0.1%
	1 年-2 年（含）	0.05%
交银双利 A 类、B 类基金份额	2 年以上	0
交银保本	1 年（含）以内	2.0%
	1 年-2 年（含）	1.6%
	2 年-3 年	1.2%
	持有到保本周期到期日	0

3) 前端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从无申购费用的交银货币、交银增利 C 类基金份额和交银双利 C 类基金份额或前端申购费用低的基金向前端申购费用高的基金转换，收取申购补差费用；从前端申购费用高的基金向前端申购费用低的基金或无申购费用的交银货币、交银增利 C 类基金份额和交银双利 C 类基金份额转换，不收取申购补差费用。申购补差费用原则上按照转出确认金额对应分档的转入基金前端申购费率减去转出基金前端申购费率差额进行补差，转出与转入基金的申购补差费率按照转出确认金额分档，并随着转出确认金额递减。前端收费模式下转出与转入基金的申购补差费率具体如下：

转出基金	转入基金	转出确认金额	转出与转入基金的申购补差
------	------	--------	--------------

		费率	
交银货币		50 万元以下	1.5%
交银增利 C 类基金份额	前端收费模式下 交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银制造、交银价值	50 万元（含）至 100 万元	1.2%
		100 万元（含）至 200 万元	0.8%
		200 万元（含）至 500 万元	0.5%
交银双利 C 类基金份额		500 万元以上（含 500 万）	每笔交易 1000 元
交银货币		100 万元以下	1.5%
交银增利 C 类基金份额	前端收费模式下 交银趋势	100 万元（含）至 500 万元	1.0%
交银双利 C 类基金份额		500 万元以上（含 500 万）	每笔交易 1000 元
交银货币		50 万元以下	0.8%
交银增利 C 类基金份额	交银双利 A 类基金份额	50 万元（含）至 100 万元	0.6%
		100 万元（含）至 200 万元	0.5%
交银双利 C 类基金份额	交银增利 A 类基金份额	200 万元（含）至 500 万元	0.3%
		500 万元以上（含 500 万）	每笔交易 1000 元
交银增利 A 类基金份额	前端收费模式下 交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银制造、交银价值	50 万元以下	0.7%
		50 万元（含）至 100 万元	0.6%
		100 万元（含）至 200 万元	0.3%
		200 万元（含）至 500 万元	0.2%
		500 万元以上（含 500 万）	0
交银增利 A 类基金份额	前端收费模式下 交银趋势	100 万元以下	0.7%
		100 万元（含）至 500 万元	0.5%

交银双利 A 类基金份额		500 万元以上（含 500 万）	0
前端收费模式下 交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值、交银保本	交银货币 交银增利 A 类、C 类基金份额 交银双利 A 类、C 类基金份额 前端收费模式下 交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值	-	0
交银增利 A 类、C 类基金份额 交银双利 A 类、C 类基金份额	交银货币	-	0
交银增利 A 类 交银双利 A 类	交银双利 A 类 交银增利 A 类	-	0
交银增利 A 类 交银双利 A 类	交银双利 C 类 交银增利 C 类	-	0
交银增利 C 类 交银双利 C 类	交银双利 C 类 交银增利 C 类	-	0
交银货币	交银增利 C 类 交银双利 C 类	-	0

备注：同一基金的 A 类、C 类基金份额之间不可转换。

4) 后端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从无申购费用的交银货币、交银增利 C 类基金份额和交银双利 C 类基金份额或后端申购费用低的基金向后端申购费用高的基金转换，不收取后端申购补差费用，但转入的基金份额赎回的时候需全额收取转入基金的后端申购费；从后端申购费用高的基金向后端申购费用低的基金或无申购费用的交银货币、交银增利 C 类基金份额和交银双利 C 类基金份额转换，收取后端申购补差费用，且转入的基金份额赎回的时候需全额收取转入基金的后端申购费。后端申购补差费用按照转出份额持有时间对应分档的转出基金后端申购费率减去转入基金后端申购费率差额进行补差。后端收费模式下转出与转入基金的申购补差费率具体如下：

转出基金	转入基金	转出份额持有时间	转出与转入基金的申购补差费率
交银货币 交银增利 B 类、C 类基金份额 交银双利 B 类、C 类基金份额 后端收费模式下 交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值	后端收费模式下 交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值	—	0
交银货币	交银增利 B 类基金份额 交银双利 B 类基金份额	—	0
后端收费模式下	交银货币	1 年（含）以内	1.8%

交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值	交银增利C类基金份额	1年-3年（含）	1.2%
		3年-5年（含）	0.6%
	交银双利C类基金份额	5年以上	0
后端收费模式下 交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值	交银增利B类基金份额	1年（含）以内	0.8%
		1年-3年（含）	0.6%
	交银双利B类基金份额	3年-5年（含）	0.2%
		5年以上	0
交银增利B类基金份额 交银双利B类基金份额	交银货币	1年（含）以内	1.0%
		1年-3年（含）	0.6%
		3年-5年（含）	0.4%
		5年以上	0
交银增利B类 交银双利B类	交银双利B类 交银增利B类	-	0
交银增利B类 交银双利B类	交银双利C类 交银增利C类	1年以内（含）	1.00%
		1年至3年（含）	0.60%
		3年至5年（含）	0.40%
		5年以上	0.00%
交银增利C类 交银双利C类	交银双利B类 交银增利B类	-	0

备注：同一基金的B类、C类基金份额之间不可转换。

5) “e网行”网上直销的申购补差费率优惠

为更好服务投资者，本基金管理人已开通中国农业银行金穗借记卡（以下简

称“农行卡”）、交通银行太平洋借记卡（以下简称“交行卡”）、中国建设银行龙卡借记卡（以下简称“建行卡”）、上海浦东发展银行借记卡（以下简称“浦发卡”）、兴业银行借记卡（以下简称“兴业卡”）、中信银行借记卡（以下简称“中信卡”）、中国民生银行借记卡（以下简称“民生卡”）和通联通道借记卡包括中国工商银行借记卡（以下简称“工行卡”）、中国光大银行借记卡（以下简称“光大卡”）、平安银行借记卡（以下简称“平安卡”）的基金网上直销业务。目前，投资者可通过“交银施罗德基金管理有限公司 e 网行基金网上直销系统”（以下简称“e 网行”）办理公司旗下部分基金的转换业务，其中部分转换可享受前端收费模式下转出与转入基金申购补差的费率优惠，转出基金的赎回费用无优惠。

网上直销基金转换费率优惠业务仅针对以下范围：

①通过本公司 e 网行由交银货币、交银增利 C 类基金份额、交银双利 C 类基金份额转入前端收费模式下的交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银制造、交银价值，享受转出与转入基金的申购补差费率优惠如下：

转出基金	转入基金	转出确认金额	转出与转入基金的日常申购补差费率	转出与转入基金的优惠申购补差费率
交银货币	前端收费模式下 交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银制造、交银价值	50 万元以下	1.5%	0.6%
交银增利 C 类基金份额		50 万元（含）至 100 万元	1.2%	0.6%
交银双利 C 类基金份额		100 万元（含）至 200 万元	0.8%	0.6%

通过 e 网行进行上述基金转换单笔转换金额超过 200 万元（含）的不享受转出与转入基金的申购补差费率优惠，按照日常转出与转入基金的申购补差费率执行。

②通过本公司 e 网行由交银货币、交银增利 C 类份额和交银双利 C 类份额转入交银双利 A 类份额和交银增利 A 类份额，享受转出与转入基金的申购补差费率优惠如下：

转出基金	转入基金	转出确认金额	转出与转入基金的日常申购补差费率	转出与转入基金的优惠申购补差费率
交银货币 交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	交银双利 A 类基金份额 交银增利 A 类基金份额	50 万元以下	0.8%	0.6%

备注：同一基金的 A 类、C 类基金份额之间不可转换。

通过 e 网行进行上述基金转换单笔转换金额超过 50 万元（含）的不享受转出与转入基金的申购补差费率优惠，按照日常转出与转入基金的申购补差费率执行。

6) 转出基金的赎回费用和已开通的其它基金转换业务的转出与转入基金的申购补差费率与网下（柜台模式）日常费率相同，不享受优惠。

7) 基金管理人可以根据法律法规及基金合同的规定对上述收费方式和费率进行调整，并应于调整后的收费方式和费率在实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。（4）基金转换份额的计算公式

1) 前端收费模式下基金转换份额的计算公式及举例

转出确认金额=转出的基金份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金的赎回费=转出确认金额×对应的转出基金的赎回费率

转入确认金额=转出确认金额-转出基金的赎回费

转出与转入基金的申购补差费=转入确认金额×对应的转出与转入基金的申购补差费率/（1+对应的转出与转入基金的申购补差费率）

（注：对于适用固定金额申购补差费用的，转出与转入基金的申购补差费=

固定金额的申购补差费)

转入基金确认份额=(转入确认金额-转出与转入基金的申购补差费+A)/转换申请当日转入基金的基金份额净值

其中:

A为货币市场基金转出的基金份额按比例结转的账户当前累计待支付收益(仅限转出基金为货币市场基金的情形,否则A为0)。

转入基金确认份额的计算精确到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,误差部分归基金财产。

例一:某投资者持有交银趋势前端收费模式的基金份额100,000份,持有期半年,转换申请当日交银趋势的基金份额净值为1.010元,交银成长的基金份额净值为2.2700元。若该投资者将100,000份交银趋势前端基金份额转换为交银成长前端基金份额,则转入交银成长确认的基金份额为:

转出确认金额=100,000×1.010=101,000元

转出基金的赎回费=101,000×0.5%=505元

转入确认金额=101,000-505=100,495元

转出与转入基金的申购补差费=100,495×0/(1+0)=0元

转入基金确认份额=(100,495-0)/2.2700=44,270.93份

例二:某投资者持有交银增利A类基金份额1,000,000份,持有期一年半,转换申请当日交银增利A类基金份额的基金份额净值为1.0200元,交银趋势的基金份额净值为1.010元。若该投资者将1,000,000份交银增利A类基金份额转换为交银趋势前端基金份额(不通过“e网行”),则转入交银趋势确认的基金份额为:

转出确认金额=1,000,000×1.0200=1,020,000元

转出基金的赎回费=1,020,000×0.05%=510元

转入确认金额=1,020,000-510=1,019,490元

转出与转入基金的申购补差费=1,019,490×0.5%/(1+0.5%)=5,072.09元

转入基金确认份额=(1,019,490-5,072.09)/1.010=1,004,374.17份

例三:某投资者持有交银增利C类基金份额100,000份,转换申请当日交银增利C类基金份额净值为1.2500元,交银精选的基金份额净值为2.2700元。若

该投资者将 100,000 份交银增利 C 类基金份额转换为交银精选前端基金份额（不通过“e 网行”），则转入交银精选确认的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.2500=125,000 元

转出基金的赎回费=0 元

转入确认金额=125,000-0=125,000 元

转出与转入基金的申购补差费=125,000×1.5%/(1+1.5%)=1,847.29 元

转入基金确认份额=(125,000-1,847.29)/2.2700=54,252.30 份

例四：某投资者持有交银货币 A 级基金份额 100,000 份，该 100,000 份基金份额未结转的待支付收益为 61.52 元，转换申请当日交银增利 A/B 类基金份额净值为 1.2700 元，交银货币的基金份额净值为 1.00 元。若该投资者将 100,000 份交银货币 A 级基金份额转换为交银增利 A 类基金份额（不通过“e 网行”），则转入确认的交银增利 A 类基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.00=100,000 元

转出基金的赎回费=0 元

转入确认金额=100,000-0=100,000 元

转出与转入基金的申购补差费=100,000×0.8%/(1+0.8%)=793.65 元

转入基金确认份额=(100,000-793.65+61.52)/1.2700=78,163.68 份

2) 后端收费模式下基金转换份额的计算公式及举例

转出确认金额=转出的基金份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金的赎回费=转出确认金额×对应的转出基金的赎回费率

转入确认金额=转出确认金额-转出基金的赎回费

转出与转入基金的申购补差费=转入确认金额×对应的转出与转入基金的申购补差费率

转入基金确认份额=(转入确认金额-转出与转入基金的申购补差费+A)/转换申请当日转入基金的基金份额净值

其中：

A 为货币市场基金转出的基金份额按比例结转的账户当前累计待支付收益（仅限转出基金为货币市场基金的情形，否则 A 为 0）。

转入基金确认份额的计算精确到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四

舍五入，误差部分归基金财产。

例五：某投资者持有交银主题后端收费模式的基金份额 100,000 份，持有期一年半，转换申请当日交银主题的基金份额净值为 1.2500 元，交银稳健的基金份额净值为 2.2700 元。若该投资者将 100,000 份交银主题后端基金份额转换为交银稳健后端基金份额，则转入交银稳健确认的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.250=125,000 元

转出基金的赎回费=125,000×0.2%=250 元

转入确认金额=125,000-250=124,750 元

转出与转入基金的申购补差费=124,750×0=0 元

转入基金确认份额=（124,750-0）/2.2700=54,955.95 份

例六：某投资者持有交银先锋后端收费模式的基金份额 100,000 份，持有期一年半，转换申请当日交银先锋的基金份额净值为 1.2500 元，交银货币的基金份额净值为 1.00 元。若该投资者将 100,000 份交银先锋后端基金份额转换为交银货币，则转入交银货币的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.250=125,000 元

转出基金的赎回费=125,000×0.2%=250 元

转入确认金额=125,000-250=124,750 元

转出与转入基金的申购补差费=124,750×1.2%=1497 元

转入基金确认份额=（124,750-1497）/1.00=123,253.00 份

例七：某投资者持有交银蓝筹后端收费模式的基金份额 100,000 份，持有期三年半，转换申请当日交银蓝筹的基金份额净值为 0.8500 元，交银增利 B 类基金份额的基金份额净值为 1.0500。若该投资者将 100,000 份交银蓝筹后端基金份额转换为交银增利 B 类基金份额，则转入交银增利 B 类基金份额的基金份额为：

转出确认金额=100,000×0.850=85,000 元

转出基金的赎回费=85,000×0=元

转入确认金额=85,000-0=85,000 元

转出与转入基金的申购补差费=85,000×0.2%=170 元

转入基金确认份额=（85,000-170）/1.0500=80,790.48 份

例八：某投资者持有交银货币 A 级基金份额 100,000 份，该 100,000 份基金

份额未结转的待支付收益为 61.52 元，转换申请当日交银增利 B 类基金份额净值为 1.2700 元，交银货币的基金份额净值为 1.00 元。若该投资者将 100,000 份交银货币 A 级基金份额转换为交银增利 B 类基金份额，则转入确认的交银增利 B 类基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.00=100,000 元

转出基金的赎回费=0 元

转入确认金额=100,000-0=100,000 元

转出与转入基金的申购补差费=100,000×0=0 元

转入基金确认份额=（100,000-0+61.52）/1.2700=78,788.60 份

（5）销售服务费

本基金各级基金份额按照不同的费率计提销售服务费，在通常情况下，本基金 A 级基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，B 级基金份额的年费率为 0.01%。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$H = E \times R \div \text{当年天数}$

H 为每级基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日该级基金份额的基金资产净值

R 为该级基金份额的销售服务费率

基金管理人可以调整对各级基金份额计提的销售服务费率，但销售服务费年费率最高不超过 0.25%。基金管理人应在调整前依照《信息披露办法》和《信息披露特别规定》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告并报中国证监会备案。

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 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、休息日等，支付日期顺延。

基金销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金营销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

上述（一）基金费用的种类中 4—8 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，从基金财产中支付。

（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。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用，不得从基金财产中列支。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

（四）基金管理费、托管费、销售服务费率的调整

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、基金托管费率和销售服务费率。调高基金管理费率、基金托管费率、销售服务费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率、销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》和《信息披露特别规定》的有关规定在指定媒体上公告。

（五）基金税收

基金运作过程中涉及的各类纳税主体，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

总体更新

本次招募说明书主要更新了“重要提示”、“基金管理人”、“基金托管人”、“相关服务机构”、“基金份额的申购、赎回及其他业务”、“基金的转换”、“基金的投资”、“基金的业绩”、“托管协议的内容摘要”以及“其他应披露事项”等部分内容。

“重要提示”部分

更新了本招募说明书所载相关内容截止日。

“三、基金管理人”部分

1、“（一）基金管理人概况”

更新相关信息。

2、“（二）主要人员情况”

“1、基金管理人董事会成员”

更新董事会成员信息。

“2、基金管理人监事会成员”

更新监事会成员信息。

“3、公司高管人员”

更新高管人员名单及信息。

“4、本基金基金经理”

更新本基金基金经理从业经验年限。

“5、投资决策委员会成员”

更新投资决策委员会成员职务信息。

3、“（六）基金管理人的内部控制制度”

更新相关信息。

“四、基金托管人”部分

更新了基金托管人基本情况、主要人员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

“（一）基金份额销售机构”

“2、代销机构”

更新代销机构的相关信息。

“九、基金份额的申购、赎回及其他业务”部分

“（十三）定期定额投资计划”

增加及更新了本基金开通定期定额投资计划的代销机构及其他相关信息。

“十、基金的转换”部分

1、“（三）转换业务办理地点”

更新了本基金与公司旗下其他基金开通转换业务的代销机构的相关信息。

2、“（五）转换业务适用的基金范围”

增加转换业务适用的基金。

3、“（八）基金转换费用”

更新及增加了本基金与公司旗下其他基金开通转换业务的费用表述。

4、“（十）业务规则”

更新相关表述。

5、“（十一）暂停基金转换”

更新相关表述。

“十一、基金的投资” 部分

更新“（十二）基金投资组合报告”。数据截止到2011年12月31日。

“十二、基金的业绩” 部分

更新基金的业绩，数据截止到2011年12月31日。

“二十二、托管协议的内容摘要” 部分

“二、基金托管人”

更新托管人经营范围相关信息。

“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

二〇一二年三月五日