



交银施罗德优势行业灵活配置混合型 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：中国工商银行股份有限公司

二〇一二年七月

【重要提示】

交银施罗德保本混合型证券投资基金经 2008 年 11 月 14 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2008】1285 号文核准募集。《交银施罗德保本混合型证券投资基金基金合同》于 2009 年 1 月 21 日正式生效。

交银施罗德保本混合型证券投资基金（以下使用全称或其简称“交银保本”）的保本周期期限为三年，自基金合同生效日起至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日，即于 2012 年 1 月 30 日保本周期到期，由于不符合保本基金存续条件，按照《交银施罗德保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，交银保本保本周期到期后转型为非保本的混合型基金，名称相应变更为“交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金”。

本基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的有关规定，并依据《交银施罗德保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，在不损害基金份额持有人利益的前提下，就变更后的“交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金”（以下简称“本基金”）修改其《基金合同》、《托管协议》及《招募说明书》，并报经中国证监会备案。

基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本招募说明书已报经中国证监会备案，但并不表明中国证监会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，对认（申）购基金的意愿、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，由于基金投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，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。本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的较高风险品种，风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

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》。过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为 2012 年 7 月 21 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2012 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：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（以下使用全称或其简称“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者的合法权益。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、量化投资部及跨境投资部。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、西部营销中心。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 2012 年二季度末，公司已经发行并管理了 20 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、3 只混合型基金、12 只股票型基金，其中 2 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 2012 年 6 月 30 日，公司有员工 198 人，其中 51.5%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、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

张迎军先生，基金经理，经济学硕士。12 年证券从业经验。2000 年 7 月至 2003 年 3 月任职于申银万国证券研究所，担任市场研究部、策略研究部研究员；2003 年 4 月至 2006 年 11 月任职于中国太平洋保险（集团）股份有限公司，担任资金运用管理中心投资经理，2006 年 12 月至 2008 年 5 月任职于太平洋资产管理有限公司，担任组合管理部组合经理。2008 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任固定收益部副总经理，现任权益部副总经理。2009 年 1 月 21 日至 2012 年 2 月 2 日担任本基金转型前的交银施罗德保本混合型证券投资基金基金经理，2012 年 2 月 3 日起担任本基金基金经理至今，并于 2011 年 5 月 3 日起兼任交银施罗德趋势优先股票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、基金经理）

战龙（总经理）

管华雨（权益部总经理、基金经理）

胡军华（固定收益部总经理）

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）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下使用全称或其简称“中国工商银行”）

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

(二) 主要人员情况

截至 2012 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 146 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三) 基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2012 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 252 只，其中封闭式 7 只，开放式 245 只。自 2003 年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 26 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

(四) 基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心

培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009 年三次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2010 年中国工商银行资产托管部第四次通过 SAS70 审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，SAS70 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心, 制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案, 并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战, 资产托管部不断提高演练标准, 从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看, 资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门, 配备专职稽核监察人员, 在总经理的直接领导下, 依照有关法律规章, 全面贯彻落实全程监控思想, 确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构, 实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与, 只有这样, 风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理, 将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位, 每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责, 通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构, 形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设, 一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力, 资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度, 包括: 岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等, 覆盖所有部门和岗位, 渗透各项业务过程, 形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一, 保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务, 资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作, 一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展, 新问题、新情况不断出现, 资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置, 视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线

(五) 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

根据《基金法》、《基金合同》、托管协议和有关基金法规的规定, 基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、

基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自《基金合同》生效之日起开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》、托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

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开户、本基金的申购、赎回及转换等业务，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

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(2) 中国农业银行股份有限公司

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：蒋超良

电话：(010) 85108227

传真：(010) 85109219

联系人：刘一宁

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(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

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(4) 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

传真：(010) 66594853

客户服务电话: 95566

网址: www.boc.cn

(5) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 3 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人: 李国华

传真: (010) 68858117

联系人: 陈春林

客户服务电话: 95580

网址: www.psbc.com

(6) 交通银行股份有限公司

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

(7) 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

(8) 上海银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 168 号

办公地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

电话：(021) 68475888

传真：(021) 68476111

联系人：张萍

客户服务电话：(021) 962888

网址：www.bankofshanghai.com

(9) 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：田国立

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

(10) 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

(11) 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

(12) 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

(13) 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

(14) 中信建投证券股份有限公司

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

(15) 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

(16) 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

(17) 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

(18) 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

(19) 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

(20) 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

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(24) 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：万鸣

客户服务电话：95597

网址: www.htsc.com.cn

(25) 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

(26) 中银国际证券有限责任公司

住所: 上海市银城中路 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

(27) 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: 杨宝林

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

(28) 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

(29) 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

(30) 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

(31) 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

(32) 中航证券有限公司

住所: 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 41 楼

办公地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 41 楼

法定代表人: 杜航

电话: (0791) 86768681

传真: (0791) 86770178

联系人: 戴蕾

客户服务电话: 400-8866-567

网址: www.avicsec.com

(33) 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

(34) 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

(35) 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

(36) 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

(37) 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) 66045608

传真：(010) 66045527

联系人：林爽

客户服务电话：(010) 66045678

网址：<http://www.txsec.com>, www.jjm.com.cn

(38) 杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

电话：(0571) 28829790, (021) 60897869

传真: (0571) 26698533

联系人: 周熾旻

客服电话: 4000-766-123

网址: www.fund123.cn

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: 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

电话: (021) 61238888

传真: (021) 61238800

联系人: 金毅

经办注册会计师: 汪棣、金毅

四、基金的名称

本基金名称: 交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金

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

根据宏观经济周期和市场环境的变化, 自上而下灵活配置资产, 积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会, 在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下, 力求实现基金资产的长期稳定增值。

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, 包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为: 股票资产占基金资产的 30%-80%; 债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%, 其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在基金实际管理过程中, 管理人将根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化, 在上述投资组合比例范围内,

适时调整基金资产在股票、债券及货币市场工具间的配置比例。

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，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整投资组合比例，自上而下灵活配置资产；通过把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挖掘预期具有良好增长前景的优势行业，精选个股，以谋求超额收益。

1、资产配置

本基金将采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统，结合定性分析和定量分析实现大类资产的灵活配置。具体而言，首先利用经济周期理论，对宏观经济的经济周期进行预测，在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在各类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，以规避或分散市场风险，提高基金收益率。同时，本基金将充分借鉴施罗德集团在配置型基金方面成功的投资经验。具体操作中，本基金管理人采用经济周期理论下的资产配置模型，通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析，对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测，然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。

2、优势行业选择

国民经济快速增长的背后蕴涵了不同行业对 GDP 增长贡献率的差异。而不同行业受宏观经济周期、行业自身生命周期以及相关结构性因素的影响在不同时期表现往往具有明显差异。

本基金管理人通过在全球经济的框架下建立交银施罗德优势行业评估体系，采用多因素的定性与定量相结合的分析 and 预测方法，确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机，据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业，把握行业景气轮换带来的投资机会。

具体操作中，我们对行业的挑选重点分为两个部分，即行业平均增长率预测

和行业综合评价。首先考察各行业历史收入和利润增长表现，对未来行业收入增长率和行业平均利润增长率进行预测；对根据预测结果计算的增长率低于 GDP 增长率的行业进行剔除。然后根据交银施罗德优势行业评估体系，对行业的综合表现和增长空间进行评估和排序，挑选出未来一段时间内最具增长前景的行业。具体评估将从宏观经济环境(重点包括宏观经济政策、产业政策对相关行业发展的影响)、行业景气度分析和预测(关注上下游行业对本行业景气度影响、密切追踪各行业景气度指标)、行业财务状况(行业盈利能力、行业经营效率)和行业竞争力综合表现四个方面入手，采用定性分析结合定量分析的方法对行业的未来的增长前景进行综合评价。

最后，在完成对行业增长预测和行业综合评价基础上，通过市场及各个行业的相对和绝对估值水平 PE、PB 等数据的横向、纵向分析，进行估值比较，并跟踪各行业的资金流向、机构持仓特征等判断行业吸引力，动态把握行业板块轮换蕴涵的投资机会。

3、股票选择

本基金综合运用施罗德集团的股票研究分析方法和其它投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合，前述优势行业中股票优先入选。具体分以下两个层次进行股票挑选：

(1) 品质筛选

筛选出在公司治理、财务及管理品质上符合基本品质要求的上市公司，构建备选股票池，主要筛选指标包括：盈利能力指标(如 P/E、P/Cash Flow、P/FCF、P/S、P/EBIT 等)、经营效率指标(如 ROE、ROA、Return on operating assets 等)和财务状况指标(如 D/A、流动比率等)。

(2) 多元化价值评估

本基金在前述优势行业选择体系的基础上，根据下述标准挑选出其中具有投资潜力的上市公司构建核心股票池：

- ①公司治理结构良好，管理规范，信息透明；
- ②主营业务鲜明，盈利能力强，收入和利润稳定增长；
- ③公司具有质量优良的成长性，通过对控制企业盈利增长质量的指标(如 ROIC-WACC、EVA 等)进行评估，挑选 EVA 不断增长或改善的优质公司；

④公司财务状况良好，具备一定的规模优势和较好的抗风险能力；

⑤公司在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相当的核心竞争优势，有良好的市场知名度和较好的品牌效应，处于行业龙头地位。

对上述核心股票池中的重点上市公司进行内在价值的评估和成长性跟踪研究，在明确的价值评估基础上选择定价相对合理且成长性可持续的投资标的。

4、债券投资策略

在债券投资方面，本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本基金的债券投资采取主动的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。

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作出判断，运用数量化工具，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略和换券等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。

5、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，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

6、资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、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、其他衍生工具投资策略

本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向，一旦有新的产品推出市场，将在届时相应法律法规的框架内，制订符合本基金投资目标的投资策略，同时结合对衍生工具的研究，在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下，谨慎进行投

资。本基金将按照相关法律法规通过利用股票指数期货及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金投资于股票指数期货主要用于避险交易及套利交易。

九、基金的业绩比较标准

本基金的整体业绩比较基准采用：

$60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中信标普全债指数收益率}$

本基金股票投资部分的业绩比较基准是沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准是中信标普全债指数。

沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成。该指数样本对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性，投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取。同时该指数引进国际指数编制和管理的经验，编制方法清晰透明，具有独立性和良好的市场流动性；与市场整体表现具有较高的相关度。沪深 300 指数是目前衡量本基金股票投资业绩的理想基准。同时，根据本基金的目标资产配置比例来分配权重，本基金的业绩比较基准中加入了中信标普全债指数并按照本基金的目标资产配置比例来安排。

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，则本基金管理人将视情况调整业绩比较基准，并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的较高风险品种，风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

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。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定, 于 2012 年 7 月 17 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 2012 年 4 月 1 日至 2012 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	263,106,423.35	55.01
	其中: 股票	263,106,423.35	55.01
2	固定收益投资	195,256,851.27	40.82
	其中: 债券	195,256,851.27	40.82
	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	15,378,892.58	3.22
6	其他各项资产	4,587,710.09	0.96
7	合计	478,329,877.29	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	7,662,286.25	1.84
C	制造业	138,276,622.81	33.28
C0	食品、饮料	71,298,193.92	17.16
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	4,540,000.00	1.09
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	6,338,105.40	1.53
C7	机械、设备、仪表	40,926,682.26	9.85
C8	医药、生物制品	15,173,641.23	3.65
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	48,453,829.05	11.66
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	22,136,401.35	5.33
H	批发和零售贸易	7,916,083.89	1.91
I	金融、保险业	28,357,500.00	6.82
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	10,303,700.00	2.48
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	263,106,423.35	63.32

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	600519	贵州茅台	118,902	28,435,413.30	6.84
2	000895	双汇发展	290,312	17,964,506.56	4.32
3	600031	三一重工	1,100,000	15,312,000.00	3.68
4	600406	国电南瑞	804,955	15,044,608.95	3.62
5	002431	棕榈园林	577,187	14,885,652.73	3.58
6	000568	泸州老窖	344,966	14,595,511.46	3.51
7	600015	华夏银行	1,530,000	14,489,100.00	3.49

8	600036	招商银行	1,270,000	13,868,400.00	3.34
9	002375	亚厦股份	508,237	12,548,371.53	3.02
10	000157	中联重科	1,200,000	12,036,000.00	2.90

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	80,763,000.00	19.44
	其中：政策性金融债	80,763,000.00	19.44
4	企业债券	111,042,387.27	26.72
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,451,464.00	0.83
8	其他	-	-
9	合计	195,256,851.27	46.99

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	090407	09农发07	500,000	50,605,000.00	12.18
2	098016	09南钢联债	400,000	40,860,000.00	9.83
3	122033	09富力债	303,440	31,709,480.00	7.63
4	070228	07国开28	200,000	20,102,000.00	4.84
5	122009	08新湖债	119,160	12,603,553.20	3.03

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) 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	763,314.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,794,839.41
5	应收申购款	29,556.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,587,710.09

(4) 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(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) 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 2012 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、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

(1) 交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金

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	4.00%	0.67%	1.04%	0.67%	2.96%	0.00%

基金转型日 2012年2月3 日—2012年 6月30日	3.81%	0.60%	0.53%	0.68%	3.28%	-0.08%
---------------------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

注：交银施罗德保本混合型证券投资基金从 2012 年 2 月 3 日起正式转型为交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金，本表列示的是基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为 60%×沪深 300 指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率。

(2) 交银施罗德保本混合型证券投资基金

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
2012年1月1日—2012年2月2日	0.37%	0.04%	0.41%	0.03%	-0.04%	0.01%
2011年度	-0.74%	0.28%	4.54%	0.01%	-5.28%	0.27%
2010年度	4.33%	0.38%	3.38%	0.01%	0.95%	0.37%
2009年度 (2009年1月21日—2009年12月31日)	7.50%	0.25%	3.19%	0.01%	4.31%	0.24%

注：交银施罗德保本混合型证券投资基金从 2012 年 2 月 3 日起正式转型为交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金，本表列示的是基金转型前的基金净值表现，转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款收益率。

2、基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(1) 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 2 月 3 日至 2012 年 6 月 30 日)



注：本基金由交银施罗德保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日（即 2012 年 2 月 3 日）至 2012 年 6 月 30 日，本基金转型时间未满一年。本基金的投资转型期为交银施罗德保本混合型证券投资基金保本周期到期选择期截止日次日（即 2012 年 2 月 3 日）起的 3 个月。截至投资转型期结束及 2012 年 6 月 30 日，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) 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德保本混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009 年 1 月 21 日至 2012 年 2 月 2 日)



注：交银施罗德保本混合型证券投资基金的建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，其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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，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，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

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，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，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托管人，若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述(一)基金费用的种类中第 3—8 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。

2. 与基金销售有关的费用

(1) 申购费用

本基金目前提供前端收费模式，即在申购时支付申购费用；日后本基金将择机开通后端收费模式，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。

本基金的申购费用由基金份额申购人承担，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
申购费率（前端）	100 万元以下	1.5%
	100 万元（含）至 500 万元	1.0%
	500 万元以上（含 500 万）	每笔交易 1000 元

	持有期限	后端申购费率
申购费率（后端）	1 年以内（含）	1.8%
	1 年—3 年（含）	1.2%
	3 年—5 年（含）	0.6%
	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

目前本基金暂只开通场外申购，且只提供前端收费模式。本基金日后将择机开通场内申购及提供后端申购模式。

1) 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=（申购总金额-申购费用）/ T 日基金份额净值

场内申购金额的有效份额保留到整数位，剩余部分对应申购资金退还投资者。

例一：某投资者投资 40,000 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 1.5%，则其可得

到的申购份额为:

申购总金额=40,000 元

净申购金额=40,000/ (1+1.5%) =39,408.87 元

申购费用=40,000-39,408.87=591.13 元

申购份额= (40,000-591.13) /1.040=37,893.14 份

如果投资者是场外申购, 申购份额为 37,893.14 份。

如果投资者是场内申购, 则申购份额为 37,893 份, 其余 0.14 份对应金额返回给投资者。

2) 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

例二: 某投资者投资 40,000 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 = 40,000 / 1.040 = 38,461.54 份

即: 投资者投资 40,000 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 38,461.54 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

赎回费用由基金份额赎回人承担, 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
赎回费率	1 年以内 (含)	0.5%
	1 年—2 年 (含)	0.2%
	2 年以上	0

本基金由交银施罗德保本混合型证券投资基金转型而来并自 2012 年 2 月 3 日起适用上述费率，原交银保本赎回费率从该日起不再适用。

交银保本基金份额持有人选择继续持有变更后的本基金的基金份额的，对应基金份额的持有期限将自基金份额持有人认购交银保本的基金份额注册登记日起连续计算，即该部分基金份额实际对应赎回费率为 0。

(4) 赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元，计算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。

1) 如果投资者在申购时选择交纳前端申购费用，则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

例三：某投资者赎回通过前端申购持有的 10,000 份基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，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 = $10,000 \times 1.016 \times 0.5\% = 50.80$ 元

赎回金额 = $10,000 \times 1.016 - 50.80 = 10,109.20$ 元

即：投资者赎回本基金 10,000 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 10,109.20 元。

2) 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

例四：某投资者赎回通过后端申购持有的 10,000 份基金份额，对应的后端申购费率是 1.8%，赎回费率为 0.5%，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= $10,000 \times 1.016 = 10,160$ 元

后端申购费用= $10,000 \times 1.010 \times 1.8\% = 181.80$ 元

赎回费用= $10,160 \times 0.5\% = 50.80$ 元

赎回金额= $10,160 - 181.80 - 50.80 = 9,927.40$ 元

即：投资者赎回本基金 10,000 份基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，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 1.8%，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 9,927.40 元。

(5) 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、交银行业、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 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、交银行业、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

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	前端收费模式下	50 万元以下	1.5%
交银增利 C 类基金份额	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	前端收费模式下	100 万元以下	1.5%
交银增利 C 类基金份额		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 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%
		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 万元以上（含 500 万）	每笔交易 1000 元
交银增利 A 类基金份额 交银双利 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	100 万元以下	0.7%
交银双利 A 类基金份额		100 万元 (含) 至 500 万元	0.5%
交银增利 A 类基金份额	交银行业、交银趋势	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、交银行业、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、交银行业、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 类基金份额 交银双利 A 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	-	0
交银增利 A 类基金份额 交银双利 A 类基金份额	交银双利 C 类基金份额 交银增利 C 类基金份额	-	0

份额	额		
交银增利 C 类基金份额	交银双利 C 类基金份额	-	0
交银双利 C 类基金份额	交银增利 C 类基金份额		
交银货币	交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	-	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	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	-	0

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	造、交银价值		
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	交银货币 交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	1 年 (含) 以内	1.8%
		1 年-3 年 (含)	1.2%
		3 年-5 年 (含)	0.6%
		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 交银双利 B 类基金份额	1 年 (含) 以内	0.8%
		1 年-3 年 (含)	0.6%
		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 交银双利 C 类基金份额 交银增利 C 类基金份额	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

	额		
交银增利 B 类基金份额	交银双利 B 类基金份额	-	0
交银双利 B 类基金份额	交银增利 B 类基金份额		
交银增利 C 类基金份额	交银双利 B 类基金份额	-	0
交银双利 C 类基金份额	交银增利 B 类基金份额		

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	转出与转入基金的优惠
------	------	--------	------------	------------

			申购补差费率	申购补差费率
交银货币	前端收费模式下	50 万元以下	1.5%	0.6%
交银增利 C 类基金份额	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			
交银双利 C 类基金份额				
		50 万元 (含) 至 100 万元	1.2%	0.6%
		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行业, 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 交银行业	100 万元以下	1.5%	0.6%
交银增利 C 类基金份额				
交银双利 C 类基金份额		100 万元 (含) 至 500 万元	1.0%	0.6%

通过 e 网行进行上述基金转换单笔转换金额超过 500 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。

③交银货币、交银增利 C 类基金份额和交银双利 C 类基金份额转入交银双利 A 类基金份额和交银增利 A 类基金份额，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。

(6) 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：

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 1.250 = 125,000 \text{ 元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 125,000 \times 0.2\% = 250 \text{ 元}$$

$$\text{转入确认金额} = 125,000 - 250 = 124,750 \text{ 元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 124,750 \times 0 = 0 \text{ 元}$$

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

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：

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 1.250 = 125,000 \text{ 元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 125,000 \times 0.2\% = 250 \text{ 元}$$

$$\text{转入确认金额} = 125,000 - 250 = 124,750 \text{ 元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 124,750 \times 1.2\% = 1497 \text{ 元}$$

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

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：

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 0.850 = 85,000 \text{ 元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 85,000 \times 0 = 0 \text{ 元}$$

$$\text{转入确认金额} = 85,000 - 0 = 85,000 \text{ 元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 85,000 \times 0.2\% = 170 \text{ 元}$$

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

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

(7) 网上交易的有关费率

本基金管理人已开通农行卡、交行卡、建行卡、浦发卡、兴业卡、中信卡、民生卡和通联通道借记卡（包括工行卡、光大卡、平安卡）的基金网上直销业务，持有上述借记卡的个人投资者可以直接通过本公司网站办理开户手续，并通过 e 网行办理本基金前端基金份额的申购、赎回和转换等业务。通过 e 网行办理本基金前端基金份额申购业务的个人投资者将享受前端申购费率的优惠，通过 e 网行办理本基金前端收费模式下转换入业务的个人投资者将享受转换费中相应前端申购补差费率的优惠，其他费率标准不变。通过 e 网行申购本基金及进行基金转换时所适用的具体优惠费率请参见公司网站列示的 e 网行直销申购及转换费率表或相关公告。

通过农行卡、交行卡或兴业卡进行网上申购的最高限额为单笔 500 万元（不含 500 万元），但不受日交易金额的限制。通过建行卡进行网上申购的最高限额为单笔 500 万元（不含 500 万元），每日累计认（申）购本基金管理人旗下所有基金的最高限额为 500 万元（含 500 万元）。通过浦发卡或中信卡进行网上申购的单笔申购及每日累计认（申）购本基金管理人旗下所有基金的最高限额为 100 万元（含 100 万元）。通过民生卡进行网上申购的最高限额为单笔 500 万元（不含 500 万元），每日累计认（申）购本基金管理人旗下所有基金的最高限额为 5000 万元（含 5000 万元）。通过通联通道借记卡进行网上申购的最高限额为单笔 500

万元 (不含 500 万元), 日交易金额限额以通联支付网络服务股份有限公司的公告为准或通过以下途径咨询:

通联支付网络服务股份有限公司客户服务电话: 95156

通联支付网络服务股份有限公司网址: www.allinpay.com

通过本公司网上交易系统办理基金转换业务, 单笔转换份额不得低于 200 份, 投资者可将其全部或部分基金份额转换成其它基金, 单笔转换申请不受转入基金最低申购限额限制。

本基金管理人可根据业务情况调整上述交易费用和限额要求, 并依据相关法规的要求提前进行公告。

(8) 基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式, 最新的费率和收费方式在更新的招募说明书中列示。费率或收费方式如发生变更, 基金管理人应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(9) 基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资人以及以特定交易方式 (如网上交易、电话交易等) 等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3、《基金合同》生效前的相关费用, 包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后, 可根据基金发展情况调整基金管理费

率和基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率或基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率等费率，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》的有关规定在指定媒体上公告。

(五) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

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”、“基金份额的申购和赎回”、“基金的转换”、“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

更新了相关表述及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)主要成员情况”

“1、基金管理人董事会成员”

更新相关表述。

“4、本基金基金经理”

更新本基金基金经理信息。

“5、投资决策委员会成员”

更新投资决策委员会成员名单以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、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

1、“(一) 基金份额销售机构”

“1、直销机构”

更新相关信息。

“2、代销机构”

更新代销机构的相关信息。

2、“(四) 审计基金财产的会计师事务所”

更新会计师事务所的办公地址。

“六、基金的募集”部分

更新相关表述。

“七、基金合同的生效”部分

增加了关于交银保本基金保本周期到期转型的相关表述。

“八、基金份额的申购和赎回”部分

1、“(一) 申购和赎回的场所”

“1、直销机构”

更新相关信息。

2、“(二) 申购和赎回的开放日及时间”

增加申购和赎回业务的开始日及业务办理时间

3、“(六) 基金的申购费和赎回费”

“3、网上交易的有关费率”

更新相关信息。

4、删除原“(十二) 基金转换”

“九、基金的转换”部分

增加本基金转换业务相关信息。

“十、基金的投资”部分

增加“(十) 基金投资组合报告”。数据截止到 2012 年 6 月 30 日。

“十一、基金的业绩”部分

增加基金的业绩，数据截止到 2012 年 6 月 30 日。

“二十二、对基金份额持有人的服务”部分

1、“(一) 持有人交易资料的寄送服务”

更新相关表述。

2、“(二) 网上交易服务”

更新相关表述。

3、“(五) 定期定额投资计划”

更新相关表述。

“二十三、其他应披露事项”部分

增加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

二〇一二年九月四日