



交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金 (更新) 招募说明书摘要

(2015 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

二零一五年六月

基金招募说明书自基金合同生效日起，每 6 个月更新一次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告，更新内容截至每 6 个月的最后 1 日。

【重要提示】

交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2012 年 9 月 25 日中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1287 号文核准募集。本基金基金合同于 2012 年 12 月 19 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：因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险；由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险；交易对手违约风险；投资本基金特有的其他风险等等。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。

本基金为发起式基金，基金管理人将公平对待所管理的全部基金，基金管理人并不能保证发起式基金不发生亏损，也不能保证发起式基金的收益将优于基金管理人管理的其他非发起式基金。基金管理人运用固有资金认购本基金 1000 万元，持有期限并不低于三年。但基金管理人对本基金的发起认购，并不代表对本基金的风险或收益的任何判断、预测、推荐和保证，基金管理人认购的发起资金也并不用于对投资者投资亏损的补偿，投资者及基金管理人均自行承担投资风险。基金管理人认购的发起份额持有期限满三年后，基金管理人将根据自身情况决定是否继续持有，

届时，基金管理人有可能赎回认购的本基金份额。基金合同生效之日起满 3 年后的对应日（如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日），若本基金的资产净值低于 2 亿元，基金合同将自动终止，且无法通过召开持有人大会延续基金合同期限，因此投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

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新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。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 2015 年 6 月 19 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 3 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：上海浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-22 楼

邮政编码：200120

法定代表人：阮红（代任）

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%

(二) 主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

于亚利女士，董事，硕士学历。现任交通银行执行董事、副行长。历任交通银行郑州分行财务会计处处长、郑州分行副行长，交通银行财务会计部副总经理、总经理，交通银行预算财务部总经理、交通银行首席财务官。

阮红女士，董事，总经理，代任董事长，博士学历，兼任交银施罗德资产管理有限公司董事长。历任交通银行办公室副处长、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，交通银行投资管理部总经理。

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。

吴伟先生，董事，博士学历。现任交通银行首席财务官，交通银行投资银行业务中心总裁，交通银行资产负债管理部总经理。历任交通银行财会部财务处主管、副处长、预算财务部副总经理、总经理、交通银行沈阳分行行长、交通银行预算财务部总经理。

孟方德先生，董事，硕士学历。现任施罗德投资管理有限公司亚太区总裁。历任施罗德投资管理有限公司分析师、投资经理，施罗德投资管理（新加坡）有限公司副董事长，施罗德投资管理国际有限公司执行董事，施罗德投资管理（卢森堡）有限公司总经理，施罗德投资管理（日本）有限公司总经理，施罗德投资管理有限公司英国区总经理及销售总监、全球渠道销售业务总监。

谢丹阳先生，独立董事，博士学历。现任武汉大学经济与管理学院院长、香港科技大学经济系教授。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、瑞安经管中心主任。

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

周林先生，独立董事，博士学历。现任上海交通大学安泰经济与管理学院院长、教授。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。

2、基金管理人监事会成员

王忆军先生，监事长，硕士学位。现任交通银行投资管理部总经理。历任交通

银行办公室副处长, 交通银行公司业务部副处长、高级经理、总经理助理、副总经理, 交通银行投资银行部副总经理, 交通银行江苏分行副行长。

裴关淑仪女士, 监事, 双硕士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司助理总经理、交银施罗德资产管理(香港)有限公司总经理。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。

陈超女士, 监事, 硕士学历。现任交银施罗德基金管理有限公司董事会秘书。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、监察稽核部总经理、董事会监事会办公室总经理。

张丽女士, 监事, 注册会计师, 学士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司投资运营部总经理, 历任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)高级审计员, 交银施罗德基金管理有限公司基金运营部高级基金会计、部门总经理助理、副总经理、总经理。

3、公司高管人员

阮红女士, 总经理、代任董事长。简历同上。

许珊燕女士, 副总经理, 硕士学历, 高级经济师, 兼任交银施罗德资产管理有限公司董事。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。

夏华龙先生, 副总经理, 博士学历。历任中国地质大学经济管理系教师、经济学院教研室副主任、主任、经济学院副院长; 交通银行资产托管部副处长、处长、高级经理、副总经理; 云南省曲靖市市委常委、副市长(挂职)。

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。

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。

乔宏军先生，副总经理，博士学历，高级经济师，兼任交银施罗德资产管理有限公司董事、总经理。历任交通银行资金部副处长、副高级经理、高级经理；交通银行金融市场部高级经理、总经理助理、副总经理；交通银行金融市场业务中心副总裁。

4、本基金基金经理

孙超先生，基金经理，中国人民大学学士，美国哥伦比亚大学硕士。4 年证券从业经验。2011 年 7 月至 2013 年 6 月曾任中信建投证券股份有限公司资产管理部经理、高级经理。2013 年加入交银施罗德基金管理有限公司，自 2013 年 7 月 8 日至 2014 年 6 月 30 日担任交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金经理助理，2013 年 7 月 8 日至 2014 年 8 月 25 日担任交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金经理助理，2013 年 7 月 8 日至 2014 年 8 月 25 日担任交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理助理，2014 年 7 月 1 日至 2014 年 8 月 25 日担任交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金经理助理，2014 年 7 月 1 日至 2014 年 8 月 25 日担任交银施罗德强化回报债券型证券投资基金基金经理助理。2014 年 8 月 26 日起担任交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金经理至今，2014 年 8 月 26 日起担任交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理至今，2014 年 8 月 26 日起担任交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金经理至今，2014 年 8 月 26 日起担任交银施罗德强化回报债券型证券投资基金基金经理至今，2014 年 12 月 15 日起担任交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金基金经理至今，2015 年 1 月 19 日起担任交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金基金经理至今，2015 年 1 月 30 日起担任交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金基金经理至今，2015 年 5 月 9 日起担任交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金经理至今。

历任基金经理：

胡军华女士，2012 年 12 月 19 日至 2014 年 3 月 30 日担任本基金基金经理。

林洪钧先生，2014 年 3 月 31 日至 2015 年 5 月 31 日担任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

委员：阮红（总经理、代任董事长）

乔宏军（副总经理）

项廷锋（投资总监、基金经理）

王少成（权益投资总监、基金经理）

张鸿羽（研究部总经理）

齐皓（跨境投资总监、投资经理）

上述人员之间无近亲属关系。上述各项人员信息更新截止日为 2015 年 6 月 19 日，期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

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

法定代表人：刘士余

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

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 140 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 2015 年 3 月 31 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 254 只, 包括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、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、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、金元惠理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、金元惠理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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (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、兴全沪深 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 (LOF)、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、金元惠理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、光大保德信行业轮

动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国 7 天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金（LOF）、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财 21 天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家 14 天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币

市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、嘉实活期宝货币市场基金、融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金、前海开源沪深 300 指数型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、招商可转债分级债券型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、中海惠祥分级债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、嘉实新兴产业股票型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、招商

招利 1 个月期理财债券型证券投资基金、工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、中证 500 医药卫生指数交易型开放式指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、鹏华先进制造股票型证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、南方理财金交易型货币市场基金、工银瑞信创新动力股票型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金、前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金、国开泰富货币市场证券投资基金、大成高新技术产业股票型证券投资基金、富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金、鹏华可转债债券型证券投资基金、华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金。

(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直销交易平台。

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: 上海浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-22 楼

法定代表人: 阮红 (代任)

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.fund001.com, www.bocomschroder.com

个人投资者可以通过本公司网上直销交易平台办理开户、本基金的申购、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。网上直销交易平台网址: www.fund001.com, www.bocomschroder.com。

2、场内代销机构

具有基金代销资格的上海证券交易所场内会员单位。(具体名单见基金份额发售公告)。

3、场外代销机构

(1) 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: 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人: 刘士余

传真: (010) 85109219

客户服务电话: 95599

网址: www.abchina.com

(2) 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

(3) 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：牛锡明

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

(4) 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：李建红

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

(5) 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 9 号文化大厦

法定代表人：常振明

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

(6) 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

(7) 江苏常熟农村商业银行股份有限公司

住所: 江苏省常熟市新世纪大道 58 号

办公地址: 江苏省常熟市新世纪大道 58 号

法定代表人: 宋建明

联系电话: (0512) 52909128

传真: (0512) 52909122

联系人: 黄晓

客户服务电话: 962000

网址: www.csrcbank.com

(8) 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人: 薛峰

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

(9) 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

(10) 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: 王常青

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

(11) 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

(12) 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

(13) 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

(14) 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

(15) 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

(16) 申万宏源证券有限公司

住所: 上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人: 李梅

电话: (021) 33389888

联系人: 李清怡

客户服务电话: 95523 或 4008895523

网址: www.sywg.com

(17) 国都证券股份有限公司

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

(18) 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

(19) 中信证券(浙江)有限责任公司

住所: 浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址: 浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法定代表人: 沈强

电话: (0571) 85776114

传真: (0571) 85783771

联系人: 李珊

客户服务电话: (0571) 95548

网址: www.bigsun.com.cn

(20) 中信证券(山东)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

(21) 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: 周杨

客户服务电话: 95536

网址: www.guosen.com.cn

(22) 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

(23) 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

(24) 申万宏源西部证券有限公司

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

(25) 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

(26) 江海证券有限公司

住所: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人: 孙名扬

电话: (0451) 85863719

传真: (0451) 82287211

联系人: 刘爽

客户服务电话: 400-666-2288

网址: www.jhzq.com.cn

(27) 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

电话: (0755) 22627802

传真: (0755) 82400862

联系人: 郑舒丽

客户服务电话: 95511-8

网址: www.pingan.com

(28) 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 27 楼

办公地址: 中国上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

法定代表人: 陈林

电话: (021) 68777222

传真: (021) 68777822

联系人: 赵洁

客户服务电话: 400-820-9898

网址: www.cnhbstock.com

(29) 中国国际金融股份有限公司

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: 丁学东

电话: (010) 65051166

传真: (010) 85679203

联系人: 杨涵宇

网址: www.cicc.com.cn

(30) 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: 程宜荪

电话: (010) 58328112

传真: (010) 58328740

联系人: 牟冲

客户服务电话: 400-887-8827

网址: www.ubssecurities.com

(31) 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: 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人: 张建华

电话: (021) 32229888

传真: (021) 68728703

联系人: 陈敏

客户服务电话: (021) 63340678

网址: www.ajzq.com

(32) 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

(33) 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

(34) 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

(35) 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: 王春峰

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

(36) 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

(37) 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

(38) 华融证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 8 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人: 宋德清

电话: (010) 58568235

传真: (010) 58568062

联系人: 黄恒

客户服务电话: (010) 58568118

网址: www.hrsec.com.cn

(39) 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: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人: 林义相

电话: (010) 66045529

传真: (010) 66045518

联系人: 尹伶

客户服务电话: (010) 66045678

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

(40) 联讯证券股份有限公司

住所: 惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址: 惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、

四层

法定代表人: 徐刚

电话: (021) 33606736

传真: (021) 33606760

联系人: 陈思

客户服务电话: 95564

网址: www.lxzq.com.cn

(41) 华西证券股份有限公司

住所: 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址: 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人: 杨炯洋

电话: (028) 86135991

传真: (028) 86150400

联系人: 周志茹

客户服务电话: 95584

网址: www.hx168.com.cn

(42) 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: 周嫵旻

客户服务电话: 4000-766-123

网址: www.fund123.cn

(43) 深圳众禄基金销售有限公司

住所: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人: 薛峰

电话: (0755) 33227953

传真: (0755) 33227951

联系人: 汤素娅

客户服务电话: 4006-788-887

网址: www.zlfund.cn, www.jjmmw.com

(44) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

电话: (021) 20691832

传真: (021) 20691861

联系人: 单丙焯

客户服务电话: 400-820-2899

网址: www.erichfund.com

(45) 上海好买基金销售有限公司

住所: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人: 杨文斌

传真: (021) 68596916

联系人: 薛年

客户服务电话: 400-700-9665

网址: www.ehowbuy.com

(46) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址: 上海杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 2 楼

法定代表人: 汪静波

电话: (021) 38600735

传真: (021) 38509777

联系人: 方成

客户服务电话: 400-821-5399

网址: www.noah-fund.com

(47) 和讯信息科技有限公司

住所: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人: 王莉

电话: (021) 20835789

传真: (021) 20835879

联系人: 周轶

客户服务电话: 4009200022

网址: <http://licaike.hexun.com/>

(48) 上海天天基金销售有限公司

住所: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址: 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

法定代表人: 其实

电话: (021) 54509998

传真: (021) 64385308

联系人: 潘世友

客户服务电话: 400-1818-188

网址: www.1234567.com.cn

(49) 北京钱景财富投资管理有限公司

住所: 北京市海淀区丹棱街 6 幢 1 号 9 层 1008-1012

办公地址: 北京市海淀区丹棱街 6 幢 1 号 9 层 1008-1012

法定代表人: 赵荣春

电话: (010) 57418829

传真: (010) 57569671

联系人: 魏争

客户服务电话: 400-678-5095

网址: www.niuji.net

(50) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所: 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 9 层

法定代表人: 陈操

电话: (010) 58325395

传真: (010) 58325282

联系人: 刘宝文

客户服务电话: 400-850-7771

网址: <http://8.jrj.com.cn/>

(51) 北京展恒基金销售有限公司

住所: 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址: 北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人: 闫振杰

电话: (010) 62020088

传真: (010) 62020355

联系人: 翟飞飞

客户服务电话: 400-888-6661

网址: www.myfund.com

(52) 一路财富(北京)信息科技有限公司

住所: 北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

办公地址: 北京西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 22 层 2208

法定代表人: 吴雪秀

电话: 010-88312877

传真: 010-88312099

联系人: 苏昊

客户服务电话: 400-001-1566

网址: <http://www.yilucaifu.com/>

(53) 上海大智慧财富管理有限公司

住所: 上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

办公地址: 上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

法定代表人: 申健

电话: 021-20219931

传真: 021-20219923

联系人: 付江

客户服务电话: 021-20219931

网址: <https://8.gw.com.cn>

(54) 上海联泰资产管理有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址: 上海市长宁区金钟路 658 弄 2 号楼 B 座 6 楼

法定代表人: 燕斌

电话: 021-51507071

传真: 021-62990063

联系人: 凌秋艳

客户服务电话: 4000-466-788

网址: www.66zichan.com

(55) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

住所: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人: 沈伟桦

电话: 010-52855713

传真: 010-85894285

联系人: 程刚

客户服务电话: 400-6099-200

网址: www.yixinfund.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) 基金注册登记机构

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: 周明

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: 俞卫锋

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(特殊普通合伙)

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

首席合伙人: 杨绍信

电话: (021) 23238888

传真: (021) 23238800

联系人: 沈兆杰

经办注册会计师: 汪棣、沈兆杰

四、基金的名称

本基金名称: 交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

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

本基金为纯债基金，在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。

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，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、分离交易可转债、资产支持证券、债券逆回购、银行存款等固定收益类资产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，但须符合中国证监会相关规定。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。因投资于分离交易可转债而产生的权证，在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出。同时本基金不参与可转换债券投资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金的投资组合比例范围为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；现金或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%。

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、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选个券。

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，形成对大类资产的预测和判断，在基金合同约定的范围内

确定债券类资产和现金类资产的配置比例，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，久期管理策略本质上是一种自上而下，通过灵活的久期策略对管理利率风险的策略。

在全球经济的框架下，本基金管理人密切关注货币信贷、利率、汇率、采购经理人指数等宏观经济运行关键指标，运用数量化工具对宏观经济运行及货币财政政策变化跟踪与分析，对未来市场利率趋势进行分析预测，据此确定合理的债券组合目标久期。

基金管理人通过以下方面的分析来确定债券组合的目标久期：

1) 宏观经济环境分析。通过跟踪分析货币信贷、采购经理人指数等宏观经济先行性经济指标，拉动经济增长的三大引擎进出口、消费以及投资等指标，判断当前经济运行在经济周期中所处的阶段，预期中央政府的货币与财政政策取向。

2) 利率变动趋势分析。在宏观经济环境分析的基础上，密切关注月度 CPI、PPI 等物价指数，货币信贷、汇率等金融运行数据，预测未来利率的变动趋势。

3) 目标久期分析。根据宏观经济环境分析与市场利率变动趋势分析，结合当期债券收益率估值水平，确定投资组合的目标久期。原则上，在利率上行通道中，通过缩短目标久期规避利率风险；在利率下行通道中，通过延长目标久期分享债券价格上涨的收益。在利率持平阶段，采用骑乘策略与持有策略，获得稳定的当前回报。

4) 动态调整目标久期。通过对国内外宏观经济数据、金融市场运行、货币政策以及国内债券市场运行跟踪分析，评估未来利率水平变化趋势，结合债券市场收益率变动与基金投资目标，动态调整组合目标久期。

(2) 期限结构配置策略

通过预期收益率曲线形态变化来调整投资组合的期限结构配置策略。根据债券收益率曲线形态、各期限段品种收益率变动、结合短期资金利率水平与变动趋势，分析预测收益率曲线的变化，测算子弹、哑铃或梯形等不同期限结构配置策略的风

险收益，形成具体的期限结构配置策略。

(3) 债券的类别配置策略

对不同类别债券的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，综合评估相同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，通过不同类别资产的风险调整后收益比较，确定组合的类别资产配置。

(4) 骑乘策略

骑乘策略，通过对债券收益曲线形状变动的预期为依据来建立和调整组合。当债券收益率曲线比较陡峭时，买入位于收益率曲线陡峭处的债券，持有一段时间后，伴随债券剩余期限的缩短与收益率水平的下降，获得一定的资本利得收益。

(5) 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。

(6) 信用债券投资策略

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：

①信用债券信用评级的变化。

②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。

原则上，购买信用（拟）增级的信用债券，减持信用（拟）降级的信用债券；

购买信用利差扩大后存在收窄趋势的信用债券，减持信用利差缩小后存在放宽趋势的信用债券。

(7) 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；研究标的的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的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。

九、基金的业绩比较标准

中债综合全价指数

中债综合全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，其指数样本涵盖国债、政策性银行债、商业银行债、地方企业债、中期票据以及证券公司短期融资券等 14 类券种，能够综合反映我国债券市场的整体投资收益情况，适合作为本基金的业绩比较基准。

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 2015 年 4 月 20 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 31 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	-	-
	其中: 股票	-	-
2	固定收益投资	302,258,789.70	90.76
	其中: 债券	302,258,789.70	90.76
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	13,307,356.35	4.00
7	其他资产	17,461,250.65	5.24
8	合计	333,027,396.70	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	10,000,000.00	7.17
	其中：政策性金融债	10,000,000.00	7.17
4	企业债券	222,468,789.70	159.54
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	69,790,000.00	50.05
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	302,258,789.70	216.76

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	124440	13 宁德投	200,000	21,382,000.00	15.33
2	124845	14 晋开发	200,000	20,798,000.00	14.91
3	122527	12 温国投	200,000	20,660,000.00	14.82
4	124711	14 象山债	200,000	20,608,000.00	14.78
5	124027	12 瑞国投	200,000	20,502,000.00	14.70

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、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除 13 中信 01 (证券代码: 122259)、13 海通 04 (证券代码: 122311) 外, 未出现被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券之一 13 中信 01 (证券代码: 122259) 的发行主体中信证券于 2015 年 1 月 18 日公告称, 公司因存在为到期融资融券合约展期的问题, 被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

报告期内本基金投资的前十名证券之一 13 海通 04 (证券代码: 122311) 的发行主体海通证券于 2015 年 1 月 19 日公告称, 公司因存在违规为到期融资融券合约展期问题, 被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

本基金管理人对上述证券投资决策程序的说明如下: 本基金管理人对证券投资特别是重仓个券的投资有严格的投资决策流程控制。本基金在对上述证券的投资也严格执行投资决策流程。在对上述证券的选择上, 严格执行公司个券审核流程。在对上述证券的持有过程中研究员密切关注债券发行主体动向。在上述处罚发生时及时分析其对投资决策的影响, 经过分析认为此事件对债券发行主体财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响, 所以不影响对上述债券基本面和投资价值的判断。

(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	6,856.82
2	应收证券清算款	9,490,225.23

3	应收股利	-
4	应收利息	7,753,740.49
5	应收申购款	210,428.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,461,250.65

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

(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 2015 年 3 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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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
A/B 类 过去三个月	1.90%	0.19%	-0.15%	0.09%	2.05%	0.10%

	2014年	10.10%	0.15%	6.54%	0.11%	3.56%	0.04%
	2013年	-0.51%	0.09%	-3.75%	0.09%	3.24%	0.00%
	2012年 (自基金 合同生效 日起至 2012年 12月31日)	0.10%	0.03%	0.04%	0.02%	0.06%	0.01%
C类	过去三个 月	1.93%	0.19%	-0.15%	0.09%	2.08%	0.10%
	2014年	9.44%	0.14%	6.54%	0.11%	2.90%	0.03%
	2013年	-1.11%	0.09%	-3.75%	0.09%	2.64%	0.00%
	2012年 (自基金 合同生效 日起至 2012年 12月31日)	0.10%	0.03%	0.04%	0.02%	0.06%	0.01%

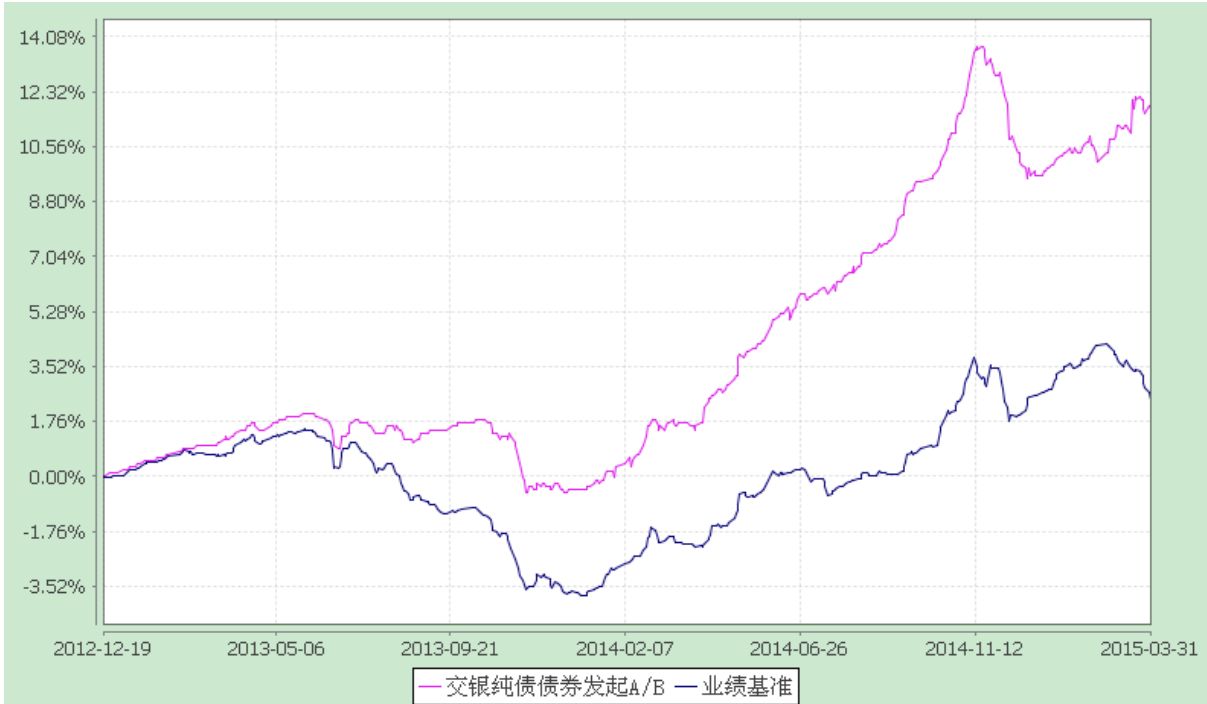
2、自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

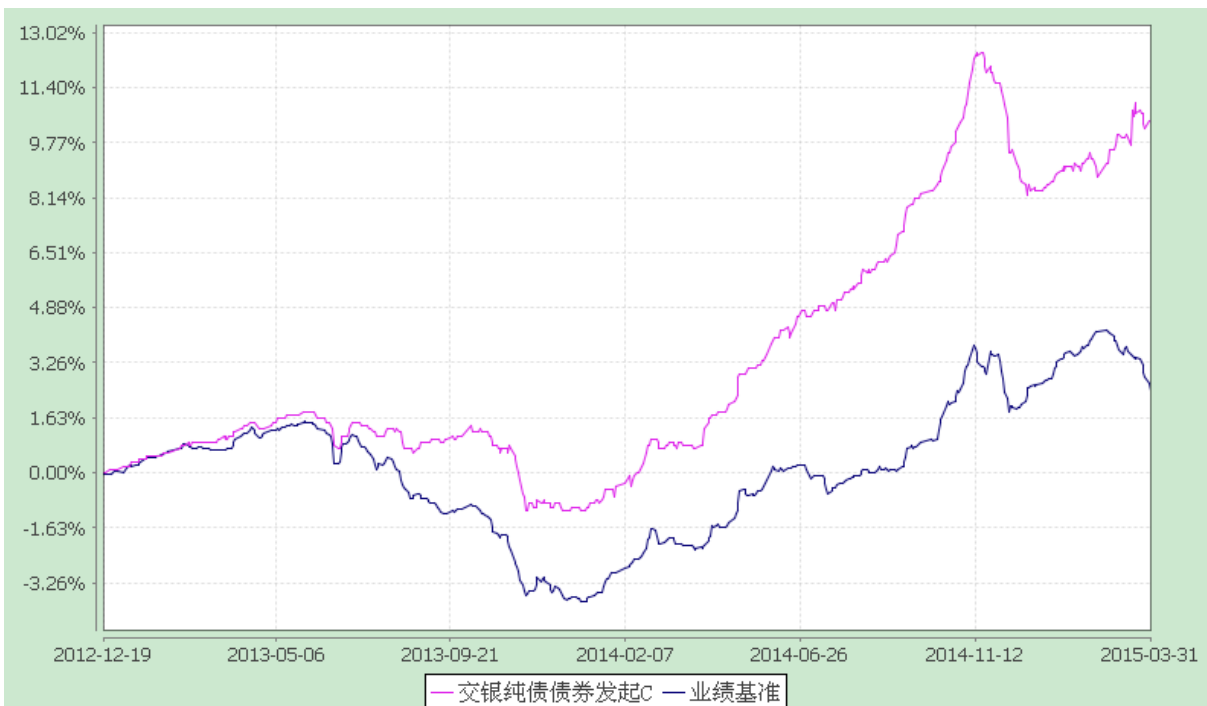
(2012年12月19日至2015年3月31日)

(1) 交银纯债债券发起 A/B



注：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，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) 交银纯债债券发起 C



注：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，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、基金财产拨划支付的银行费用；
- 8、证券账户开户费用和银行账户维护费；
- 9、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提销售服务费；
- 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 0.6% 年费率计提。计算方法如下：

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

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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

(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 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

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

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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

(3) 上述 (一) 中 3 到 8、10 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

(1) 申购费

本基金基金份额分为 A 类、B 类和 C 类基金份额。投资者申购 A 类基金份额支付申购费用，申购 B 类基金份额在赎回时才支付相应的申购费用，申购 C 类基金份额不支付申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

A/B 类基金份额的申购费用由 A/B 类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、登记结算等各项费用。

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 A 类基金份额的申购费率如下：

申购金额 (含申购费)	A 类基金份额前端申购费率
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

本基金 B 类基金份额的申购费率如下：

持有期限	B 类基金份额后端申购费率
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

持有 A/B 类基金份额的基金投资者因红利自动再投资而产生的 A/B 类基金份额, 不收取相应的申购费用。

本基金自 2013 年 4 月 11 日起, 对通过本公司直销柜台申购本基金 A 类基金份额的养老金客户实施特定申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等, 具体包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型, 本公司将发布临时公告将其纳入养老金客户范围, 并按规定向中国证监会备案。

通过本公司直销柜台申购本基金 A 类基金份额的养老金客户特定申购费率如下表:

	申购金额 (含申购费)	A 类特定申购费率
特定申购费率 (A 类)	50 万元以下	0.32%
	50 万元 (含) 至 100 万元	0.18%
	100 万元 (含) 至 200 万元	0.10%
	200 万元 (含) 至 500 万元	0.06%
	500 万元以上 (含 500 万)	每笔交易 1000 元

有关养老金客户实施特定申购费率的具体规定以及活动时间如有变化, 敬请投资人留意本公司发布的相关公告。

(2) 申购份额的计算

1) A 类基金份额的申购

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)

$$\text{申购费用} = \text{申购总金额} - \text{净申购金额}$$

(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)

$$\text{申购份额} = \frac{\text{申购总金额} - \text{申购费用}}{T \text{日} A / B \text{类基金份额净值}}$$

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投资者。

例一: 某投资者投资 100,000 元申购本基金的 A 类基金份额 (非网上交易), 假设申购当日 A/B 类基金份额净值为 1.040 元, 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:

$$\text{申购总金额} = 100,000 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 0.8\%) = 99,206.35 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 99,206.35 = 793.65 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = (100,000 - 793.65) / 1.040 = 95,390.72 \text{ 份}$$

如果该投资者是场内申购, 申购份额为 95,390 份, 其余 0.72 份对应金额返回给投资者。

2) B 类基金份额的申购

$$\text{申购总金额} = \text{申请总金额}$$

$$\text{申购份额} = \frac{\text{申购总金额}}{T \text{日} A / B \text{类基金份额净值}}$$

当投资者提出赎回时, 后端申购费用的计算方法为:

$$\text{后端申购费用} = \text{赎回份额} \times T \text{日} A / B \text{类基金份额净值} \times \text{后端申购费率}$$

例二: 某投资者投资 100,000 元申购本基金的 B 类基金份额, 假设申购当日 A/B 类基金份额净值为 1.040 元, 则其可得到的申购份额为:

$$\text{申购份额} = 100,000 / 1.040 = 96,153.85 \text{ 份}$$

即: 投资者投资 100,000 元申购本基金的 B 类基金份额, 假设申购当日 A/B 类基金份额净值为 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) C 类基金份额的申购

如果投资者选择申购 C 类基金份额，则申购份额的计算方法如下：

申购总金额=申请总金额

申购份额=申购总金额/T 日 C 类基金份额净值

例三：某投资者投资 100,000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.040 元，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 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.040 元，则其可得到 96,153.85 份 C 类基金份额。

(3) 赎回费

投资者赎回 A 类和 B 类基金份额收取赎回费用，该费用随基金份额的持有时间递减，赎回 C 类基金份额不收取赎回费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类、B 类基金份额的赎回费用由 A 类、B 类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 A/B 类基金份额的赎回费率如下：

持有期限	赎回费率
1 年以内 (含)	0.1%
1 年—2 年 (含)	0.05%
2 年以上	0

(4) 赎回金额的计算

1) A 类基金份额的赎回

如果投资者赎回 A 类基金份额，则赎回金额的计算方法如下：

赎回费用=赎回份额×T 日 A/B 类基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T 日 A/B 类基金份额净值-赎回费用

例四：某投资者赎回 100,000 份 A 类基金份额，对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日 A/B 类基金份额净值是 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 100,000 万份 A 类基金份额，假设赎回当日 A/B 类基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为 101,498.40 元。

2) B 类基金份额的赎回

如果投资者赎回 B 类基金份额，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份额×T 日 A/B 类基金份额净值

后端（认）申购费用=赎回份额×（认）申购日基金份额净值×后端（认）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（认）申购费用-赎回费用

例五：某投资者赎回 100,000 份 B 类基金份额，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 A/B 类基金份额净值是 1.016 元，申购时的 A/B 类基金份额净值为 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 100,000 份 B 类基金份额，对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日 A/B 类基金份额净值是 1.016 元，投资者对应的后端申购费率是 1.0%，申购时的 A/B 类基金份额净值为 1.010 元，则其可得到的赎回金额为 100,488.40 元。

3) C 类基金份额的赎回

投资者赎回 C 类基金份额，赎回金额的计算方法如下：

赎回金额=赎回份数×赎回当日 C 类基金份额净值

例六：某投资者赎回 100,000 份 C 类基金份额，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.250 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=100,000×1.250=125,000 元

即：投资者赎回 100,000 份 C 类基金份额，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.250 元，则其可得到的赎回金额为 125,000 元。

(5) 销售服务费

本基金 A 类和 B 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金的推广、销售与基金份额持有人服务。

(6) 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、转入基金的申购补差费用构成。

2) 转出基金的赎回费用

转出基金的赎回费用按照各基金最新的更新招募说明书及相关公告规定的赎回费率和计费方式收取，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。

3) 前端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从不收取申购费用的基金或前端申购费用低的基金向前端申购费用高的基金转换，收取前端申购补差费用；从前端申购费用高的基金向前端申购费用低的基金或不收取申购费用的基金转换，不收取前端申购补差费用。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。

4) 后端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从不收取申购费用的基金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不收取申购费用的基金转换, 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。

5) 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基金网上直销业务, 个人投资者可以通过“网上直销交易平台”办理基金转换业务, 其中部分转换业务可享受转换费率优惠, 优惠费率只适用于转出与转入基金申购补差费用, 转出基金的赎回费用无优惠。可通过网上直销交易平台办理的转换业务范围及转换费率优惠的具体情况请参阅本基金管理人网站。

具体转换费率水平请参见本基金管理人网站 (www.fund001.com, www.bocomschroder.com) 列示的相关转换费率表或相关公告。

6) 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。

(7) 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 (非网上交易), 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 (非网上交易), 则转入交银精选确认的基金份额为:

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 1.2500 = 125,000 \text{ 元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 0 \text{ 元}$$

$$\text{转入确认金额} = 125,000 - 0 = 125,000 \text{ 元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 125,000 \times 1.5\% / (1 + 1.5\%) = 1,847.29 \text{ 元}$$

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

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 (非网上交易), 则转入确认的交银增利 A 类基金份额为:

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 1.00 = 100,000 \text{ 元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 0 \text{ 元}$$

$$\text{转入确认金额} = 100,000 - 0 = 100,000 \text{ 元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 100,000 \times 0.8\% / (1 + 0.8\%) = 793.65 \text{ 元}$$

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

2) 后端收费模式下基金转换份额的计算公式及举例

$$\text{转出确认金额} = \text{转出的基金份额} \times \text{转换申请当日转出基金的基金份额净值}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = \text{转出确认金额} \times \text{对应的转出基金的赎回费率}$$

$$\text{转入确认金额} = \text{转出确认金额} - \text{转出基金的赎回费}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = \text{转入确认金额} \times \text{对应的转出与转入基金的申购补差费率}$$

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

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：

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

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

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

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

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

(8) 网上直销的有关费率

本基金管理人已开通基金网上直销交易业务，个人投资者可以直接通过本公司网站的“交银施罗德基金管理有限公司网上直销交易平台”（以下简称“网上直销交易平台”）办理开户和本基金 A 类及 C 类基金份额的申购、赎回、定期定额投资和转换等业务。本公司暂不开展网上直销交易平台 B 类基金份额的认/申购业务，通过转托管转入网上直销交易账户的本基金 B 类基金份额只能办理赎回业务。通过网上直销交易平台办理本基金 A 类基金份额申购和定期定额投资业务的个人投资者将享受前端申购费率优惠，通过网上直销交易平台进行基金转换，从各基金招募说明书所载的零申购费率的基金转换入非零申购费率的基金，转出与转入基金的前端申购补差费率将享受优惠，其他费率标准不变。具体优惠费率请参见公司网站列示的网上直销申购、定期定额投资及转换费率表或相关公告。

本公司基金网上直销业务已开通的银行卡及各银行卡交易金额限额请参阅本公司网站。

个人投资者通过本基金管理人网上直销交易平台申购本基金 A 类、C 类基金份额的单笔最低金额为 100 元（含），单笔定期定额投资最低金额为 100 元（含）；单笔转换份额不得低于 100 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。

(9) 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。

(10) 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，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调整基金申购费率、赎回费率和转换费率。

(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、律师费和会计师费以及其他费用不得从基金财产中列支。

(四) 基金管理费和基金托管费的调整

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、基金托管费率和 C 类基金份额销售服务费。降低基金管理费率、基金托管费率和 C 类基金份额销售服务费，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和基金管理人网站上刊登公告。

(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

- (一) 更新了“重要提示”中相关内容。
- (二) 更新了“三、基金管理人”中相关内容。
- (三) 更新了“四、基金托管人”中相关内容。

(四) 更新了“五、相关服务机构”中相关内容。

(五) 更新了“十、基金的投资”中“基金投资组合报告”相关内容，数据截止到 2015 年 3 月 31 日。

(六) 更新了“十一、基金的业绩”中相关内容，数据截止到 2015 年 3 月 31 日。

(七) 更新了“十三、基金资产的估值”中上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种估值方法改为主要依据第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

(八) 更新了二十一、托管协议的内容摘要”中相关内容。

(九) 更新了“二十三、其他应披露事项”中的相关内容。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一五年八月三日