



# 交银施罗德强化回报债券型证券投资基金 (更新) 招募说明书摘要 (2015年第2号)

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

二〇一五年七月

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】

交银施罗德强化回报债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2013 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

【2013】1443 号文准予募集注册。本基金基金合同于 2014 年 1 月 28 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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。投资人在投资本基金前，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。投资人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，其风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种。

投资有风险，投资人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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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 7 月 28 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 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，交银银行首席财务官。

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。

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。

陶文先生，董事，硕士学位。现任交通银行个人金融业务部总经理。历任交通银行徐州分行副行长、行长，交通银行南京分行副行长，交通银行海南分行行长。

孙培基先生，董事，大学学历。现任交通银行风险管理部副总经理。历任交通银行财会部副处长，交通银行董事会办公室副处长、处长，交通银行预算财务部高级经理，交通银行海南分行副行长，交通银行审计部副总经理。

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、高级管理人员

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

赵凌琦女士，基金经理，财政部财政科研所经济学硕士，11 年金融投资经验。2004 年至 2005 年在中国航空集团财务公司任投资经理，2005 年至 2013 年在中国人寿资产管理有限公司任投资经理。2013 年加入交银施罗德基金管理有限公司，现任固定收益部副总经理。2013 年 9 月 3 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 1 月 28 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 3 月 31 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 3 月 31 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 11 日起担任交银施罗德丰盈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信用添利债券证券投资基金 (LOF) 基金经理至今，2015 年 5 月 9 日起担任交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理至今。

李德亮先生，基金经理，同济大学管理学学士，中国人民银行研究生部金融学硕士。9 年证券从业经验。2006 年加入交银施罗德基金管理有限公司，曾任行业分析师、基金经理助理，2013 年 9 月 4 日起担任交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金经理至今，2014 年 1 月 28 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 10 月 22 日起担任交银施罗德蓝筹股票证券投资基金基金经理至今，自 2015 年 7 月 1 日起担任交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金基金经理至今。

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，2015 年 7 月 18 日起担任交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理至今。

#### 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 7 月 28 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：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）

住所：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

成立时间：1987 年 4 月 7 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：467.873 亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125 号

联系人：中信银行资产托管部

联系电话：（010）89936330

传真：（010）85230024

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同行业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

中信银行（601998.SH、0998.HK）成立于 1987 年，原名中信实业银行，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展，中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大，于 2005 年

8 月, 正式更名“中信银行”。2006 年 12 月, 以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东, 正式成立中信银行股份有限公司。同年, 成功引进战略投资者, 与欧洲领先的西班牙对外银行 (BBVA) 建立了优势互补的战略合作关系。

2007 年 4 月 27 日, 中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。

2009 年, 中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司 (简称: 中信国金) 70.32% 股权。经过二十多年的发展, 中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一, 是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

2009 年, 中信银行通过了美国 SAS70 内部控制审订并获得无保留意见的 SAS70 审订报告, 表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

## 2、主要人员情况

李庆萍, 行长, 高级经济师。1984 年 8 月至 2007 年 1 月, 任中国农业银行总行国际业务部干部、副处长、处长、副总经理、总经理。2007 年 1 月至 2008 年 12 月, 任中国农业银行广西分行党委书记、行长。2009 年 1 月至 2009 年 5 月, 任中国农业银行零售业务总监兼个人业务部、个人信贷业务部总经理。2009 年 5 月至 2013 年 9 月, 任中国农业银行总行零售业务总监兼个人金融部总经理。2013 年 9 月至 2014 年 7 月, 任中国中信股份有限公司副总经理。2014 年 7 月, 任中国中信股份有限公司副总经理、中信银行行长。

苏国新先生, 中信银行副行长, 分管托管业务。曾担任中信集团办公厅副主任、同时兼任中信集团董事长及中信银行董事长秘书。1997 年 6 月开始担任中信集团董事长秘书。1991 年 8 月至 1993 年 10 月, 在中国外交部工作。1993 年 10 月至 1997 年 5 月在中信集团负责外事工作。1996 年 1 月至 1997 年 1 月, 在瑞士银行 SBC 和瑞士联合银行 UBS 等金融机构工作。

刘泽云先生, 现任中信银行股份有限公司资产托管部总经理, 经济学博士。1996 年 8 月进入本行工作, 历任总行行长秘书室科长、总行投资银行部处经理、总行资产保全部主管、总行国际业务部总经理助理、副总经理、副总经理 (主持工作)。

## 3、基金托管业务经营情况

2004 年 8 月 18 日, 中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准, 取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则, 切实履行托管人职责。

截至 2014 年 12 月 31 日, 中信银行已托管 52 只开放式证券投资基金及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII 等其他托管资产, 托管总规模 3.5 万亿元人民币。

## (二) 基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标。强化内部管理, 确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行; 建立完善的规章制度和操作规程, 保证基金托管业务持续、稳健发展; 加强稽核监察, 建立高效的风险监控体系, 及时有效地发现、分析、控制和避免风险, 确保基金财产安全, 维护基金份额持有人利益。

2、内部控制组织结构。中信银行总行建立了风险管理委员会, 负责全行的风险控制和风险防范工作; 托管部内设内控合规岗, 专门负责托管部内部风险控制, 对基金托管业务的各个工作环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核监察。

3、内部控制制度。中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定, 以控制和防范基金托管业务风险为主线, 制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业务内控检查实施细则》等一整套规章制度, 涵盖证券投资基金托管业务的各个环节, 保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发展。

4、内部控制措施。建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规范等, 从制度上、人员上保证基金托管业务稳健发展; 建立了安全保管基金财产的物质条件, 对业务运行场所实行封闭管理, 在要害部门和岗位设立了安全保密区, 安装了录像、录音监控系统, 保证基金信息的安全; 建立严密的内部控制防线和业务授权管理等制度, 确保所托管的基金财产独立运行; 营造良好的内部控制环境, 开展多种形式的持续培训, 加强职业道德教育。

## (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

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定, 对基金的投资运作、基金资产净值计算、

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的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。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。基金托管人发现基金管理人重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额销售机构

##### 1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人以及基金管理人的网上直销交易平台。

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](http://www.fund001.com)，[www.bocomschroder.com](http://www.bocomschroder.com)

个人投资者可以通过基金管理人网上直销交易平台办理开户、本基金的申购、赎回、定期定额投资、转换等业务，具体交易细则请参阅基金管理人网站。

网上直销交易平台网址：[www.fund001.com](http://www.fund001.com)，[www.bocomschroder.com](http://www.bocomschroder.com)。

##### 2、场内代销机构

具有基金销售资格的上海证券交易所场内会员单位（具体名单见上海证券交易所

所网站)。

### 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](http://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](http://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](http://www.hzbank.com.cn)

(7) 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：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

(8) 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

(9) 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

(10) 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](http://www.xyzq.com.cn)

(11) 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](http://www.cs.ecitic.com)

(12) 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](http://www.sywg.com)

(13) 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](http://www.guodu.com)

(14) 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

(15) 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

(16) 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

(17) 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

(18) 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

(19) 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

(20) 长城国瑞证券有限公司

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：王勇

电话: (0592) 5161642

传真: (0592) 5161640

联系人: 赵钦

客户服务电话: (0592) 5163588

网址: [www.xmzq.cn](http://www.xmzq.cn)

(21) 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](http://www.cicc.com.cn)

(22) 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](http://www.ubssecurities.com)

(23) 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](http://www.cc168.com.cn)

(24) 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.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

(25) 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) 28451991

传真: (022) 28451892

联系人: 蔡霆

客户服务电话: 400-651-5988

网址: [www.bhzq.com](http://www.bhzq.com)

(26) 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](http://www.cindasc.com)

(27) 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: 余维佳

电话: (023) 63786141

传真: (023) 63786212

联系人: 张煜

客户服务电话: 400-809-6096

网址: [www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

(28) 华龙证券有限责任公司

住所: 兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心

办公地址: 兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心

法定代表人: 李晓安

电话: (0931) 4890208

传真: (0931) 4890628

联系人: 李昕田

客户服务电话: 4006898888、(0931) 4890208

网址: [www.hlzqgs.com](http://www.hlzqgs.com)

(29) 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](http://www.china-invs.cn)

(30) 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](http://www.jjm.com.cn)

(31) 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](http://www.lxzq.com.cn)

(32) 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](http://www.hx168.com.cn)

(33) 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](http://www.fund123.cn)

(34) 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](http://www.zlfund.cn), [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(35) 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: 单丙焜

客户服务电话: 400-820-2899

网址: [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(36) 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](http://www.ehowbuy.com)

(37) 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/>

(38) 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](http://www.1234567.com.cn)

(39) 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](http://www.niuji.net)

(40) 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/>

(41) 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](http://www.myfund.com)

(42) 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/>

(43) 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>

(44) 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](http://www.66zichan.com)

(45) 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](http://www.yixinfund.com)

(46) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

电话：(0571) 88911818

传真：(0571) 86800423

联系人：吴强

客户服务电话：400-877-3772

网址：[400-877-3772](http://400-877-3772)

(47) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208

法定代表人：罗细安

电话：(010) 670009888

传真：(010) 670009888-6000

联系人：李皓

客户服务电话：400-001-8811

网址：[www.zengcaiwang.com](http://www.zengcaiwang.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) 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：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

### (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：交银施罗德强化回报债券型证券投资基金

## 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

本基金在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，重点投资于债券资产，力争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，包括国内依法发行交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换债券及可分离转债、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类品种，和股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种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）。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；对股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产净值的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

## 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、规范化的基本面研究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，动态调整债券、股票等大类资产比例。本基金以债券投资为核心，重点关注债券组合久期调整、期限结构配置及债券类属配置，并在严谨深入的信用分析

基础上, 综合考量信用债券的信用评级, 以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等, 同时本基金也通过综合运用骑乘操作、套利操作等策略精选个券, 提高投资组合收益。此外, 在风险可控的前提下, 本基金适度关注股票、权证市场的运行状况与相应风险收益特征, 有效把握投资机会, 适时增强组合收益。

### 1、资产配置策略

本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上, 结合定性分析和定量分析的方法, 形成对各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资产、权益类资产和现金类资产的配置比例, 并根据市场运行状况以及各类资产预期表现的相对变化, 动态调整大类资产的配置比例, 有效控制基金资产运作风险, 提高基金资产风险调整后收益。

### 2、债券投资策略

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, 自上而下决定债券组合久期及债券类属配置; 在严谨深入的信用分析基础上, 综合考量信用债券的信用评级, 以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等, 自下而上地精选个券。

#### (1) 久期管理策略

在全球经济的框架下, 本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化做出判断, 密切跟踪 CPI、PPI、汇率、M2 等利率敏感指标, 运用数量化工具, 对未来市场利率趋势进行分析与预测, 并据此确定合理的债券组合目标久期, 通过合理的久期控制实现对利率风险的有效管理。

#### (2) 期限结构配置策略

本基金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。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) 债券的类属配置策略

本基金定性和定量地分析不同类属债券类资产的信用风险、流动性风险、市场

风险等因素及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力，通过比较并合理预期不同类属债券类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整不同类属债券类资产间的配置。

#### (4) 杠杆放大策略

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

#### (5) 信用债券投资策略

本基金通过宏观经济运行、发行主体的发展前景和偿债能力、国家信用支撑等多重因素的综合考量对信用债券进行信用评级，并在信用评级的基础上，建立信用债券池；然后基于既定的目标久期、信用利差精选个券进行投资。具体而言，本基金信用债券的投资遵循以下流程：

##### ① 信用债券研究

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

##### ② 信用债券筛选

本基金从信用债券池中精选债券构建信用债券投资组合，债券筛选主要考虑以下因素：

a、信用债券信用等级的变化。

b、不同信用等级的信用债券，以及同一信用等级不同标的债券之间的信用利差变化。本基金密切关注供求关系、税收、利率、投资人结构与行为以及市场的深度、广度和制度建设等因素对信用利差的影响，对个券进行有效的信用利差交易。

#### (6) 资产支持证券（含资产收益计划）投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券

收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

#### (7) 可转换债券投资策略

可转换债券是兼具股性和债性双重特征的投资品种。本基金对于可转换债券股性的研究将依托于公司投研团队对标的股票的研究,在此基础上量化投资部利用可转换债券定价模型,充分考虑转债发行后目标转债标的股票股价波动率可能出现的变化,对目标转债的股性进行合理定价。对于可转换债券债性的研究,本基金将引进公司信用债券信用评级指标体系,对可转换债券的发行主体及标的债券进行信用评级,并在信用评级的基础上对其进行合理定价。通过对标的转债股性与债性的合理定价,力求寻找出被市场低估的品种,构建本基金可转换债券的投资组合。

#### 3、股票投资策略

本基金将在严格控制投资风险前提下适度参与股票资产投资。本基金将综合运用交银施罗德股票研究分析方法和其它投资分析工具,充分发挥研究团队主动选股优势,自下而上精选具有投资潜力的股票构建投资组合。

#### 4、权证投资策略

本基金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、流动性及风险收益特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求当期稳定的基金资产收益。

## 九、基金的业绩比较基准

### 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各类券种,综合反映了债券市场整体价格和回报情况,是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。该指数合理、透明、公开,具有较好的市场接受度,作为衡量本基金债券投资部分业绩的比较基准,较为合适。

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, 而无需召开基金份额持有人大会。

## 十、基金的风险收益特征

本基金是一只债券型基金, 其风险与预期收益高于货币市场基金, 低于混合型基金和股票型基金, 属于证券投资基金中中等风险的品种。

## 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。

本基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2015 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 2015 年 4 月 1 日起至 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	36,803,978.38	8.40
	其中: 股票	36,803,978.38	8.40
2	固定收益投资	313,715,834.49	71.61
	其中: 债券	313,715,834.49	71.61

	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	83,500,959.73	19.06
7	其他资产	4,047,284.70	0.92
8	合计	438,068,057.30	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	采矿业	-	-
C	制造业	20,619,373.70	6.93
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服 务业	-	-
J	金融业	8,213,604.68	2.76
K	房地产业	5,931,000.00	1.99
L	租赁和商务服务业	2,040,000.00	0.69

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	36,803,978.38	12.37

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	600816	安信信托	119,974	5,977,104.68	2.01
2	000596	古井贡酒	120,000	5,601,600.00	1.88
3	600963	岳阳林纸	359,930	3,602,899.30	1.21
4	002285	世联行	150,000	3,216,000.00	1.08
5	000800	一汽轿车	125,000	3,110,000.00	1.05
6	000030	富奥股份	250,000	2,892,500.00	0.97
7	600325	华发股份	150,000	2,715,000.00	0.91
8	600016	民生银行	225,000	2,236,500.00	0.75
9	603555	贵人鸟	50,000	2,089,000.00	0.70
10	000061	农产品	100,000	2,040,000.00	0.69

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	131,093,600.00	44.07
	其中: 政策性金融债	131,093,600.00	44.07
4	企业债券	116,592,707.49	39.20
5	企业短期融资券	49,959,000.00	16.80
6	中期票据	15,333,500.00	5.15
7	可转债	247,027.00	0.08
8	可交换债	490,000.00	0.16
9	其他	-	-
10	合计	313,715,834.49	105.46

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	150411	15 农发 11	370,000	37,159,100.00	12.49
2	150205	15 国开 05	300,000	29,241,000.00	9.83
3	127106	14 黑债 01	200,000	20,770,000.00	6.98

4	118326	15 宁证 01	200,000	20,000,000.00	6.72
5	150413	15 农发 13	200,000	19,986,000.00	6.72

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

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	444,368.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	3,587,295.89
5	应收申购款	15,620.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,047,284.70

(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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、本基金本报告期末未持有处于交换期的可交换债券。

2、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 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

(1) 交银强化回报债券 A/B:

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	5.97%	0.48%	1.35%	0.10%	4.62%	0.38%
2015 年度上半年	11.28%	0.39%	1.20%	0.10%	10.08%	0.29%
2014 年度 (自基金合同生效日起至 2014 年 12 月 31 日)	7.78%	0.29%	5.72%	0.11%	2.06%	0.18%

(2) 交银强化回报债券 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	5.99%	0.49%	1.35%	0.10%	4.64%	0.39%
2015 年度上半年	11.21%	0.39%	1.20%	0.10%	10.01%	0.29%
2014 年度 (自基金合同生效日起至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%	0.19%

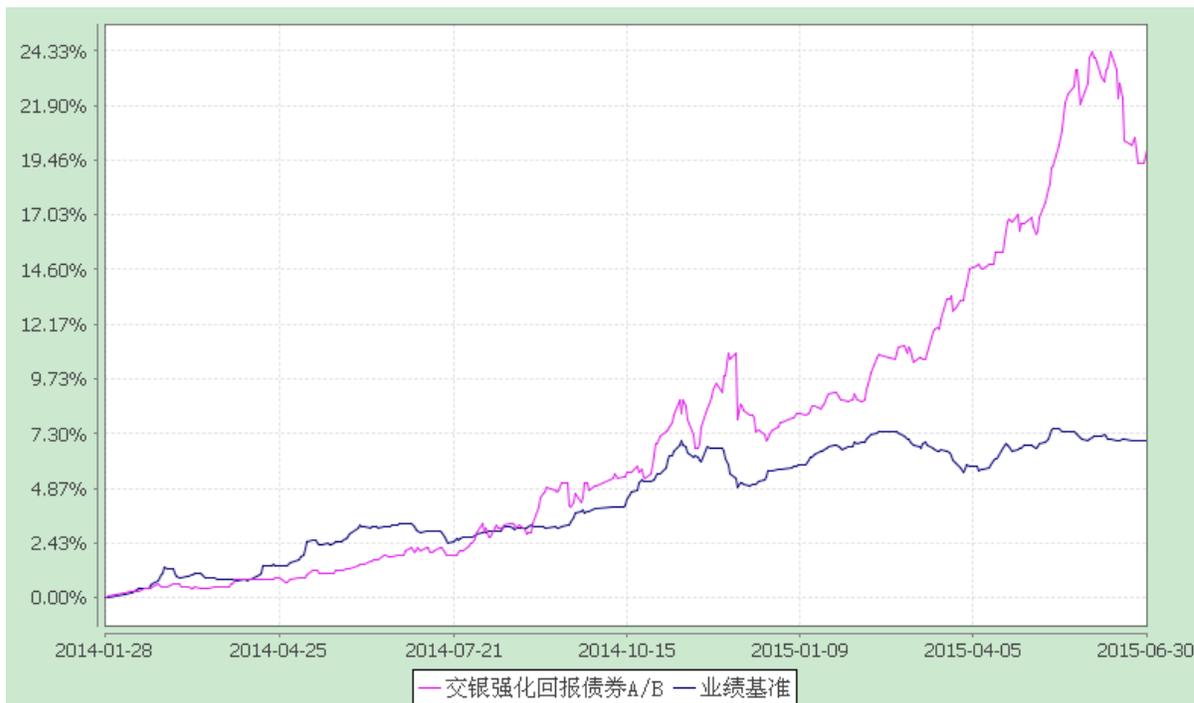
2、自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

## 交银施罗德强化回报债券型证券投资基金

### 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

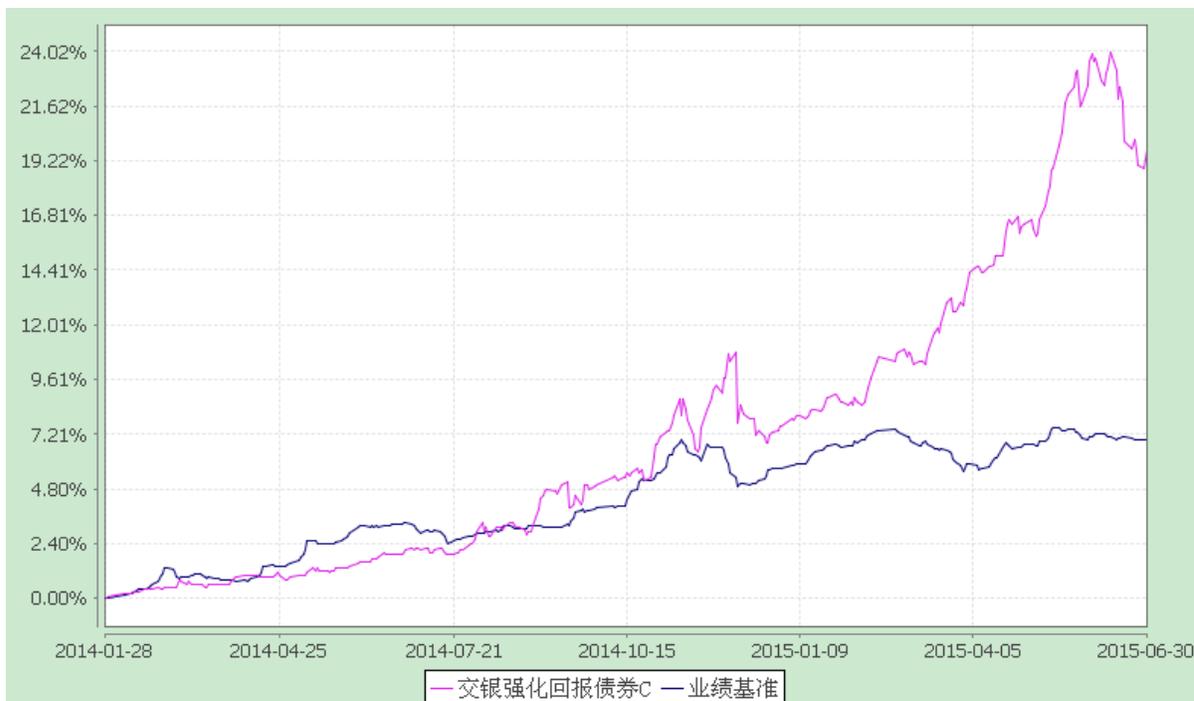
(2014 年 1 月 28 日至 2015 年 6 月 30 日)

#### (1) 交银强化回报债券 A/B



注：本基金基金合同生效日为 2014 年 1 月 28 日，截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，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) 交银强化回报债券 C



注：本基金基金合同生效日为 2014 年 1 月 28 日，截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，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、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；

10、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。

## (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 0.7% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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。由基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起第 3 个工作日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,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 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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。由基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人复核后于次月首日起第 3 个工作日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,支付日期顺延。

#### (3) C 类基金份额的销售服务费

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:

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提, 按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后, 由基金托管人复核后于次月首日起第 3 个工作日从基金财产中一次性支付给基金管理人, 由基金管理人代付给销售机构, 若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 支付日期顺延。

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。

## 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。投资人申购 A 类基金份额在申购时支付申购费用, 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。

投资人可以多次申购本基金, 申购费用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 万元以上 (含 500 万)	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

上表中的“年”指的是 365 个自然日。

持有 A/B 类基金份额的投资人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 2014 年 2 月 28 日起, 对通过基金管理人直销柜台申购 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保险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。

通过基金管理人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 类基金份额前端特定申购费率
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

### (a) 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)

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

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退还投资者。

例一：某投资者（非养老金客户）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，则其可得到的申购份额为 95,390 份，其余 0.72 份对应金额返回给投资者。

例二：某养老金客户投资 100,000 元通过基金管理人的直销柜台申购本基金的 A 类基金份额，假设申购当日 A/B 类基金份额净值为 1.040 元，申购费率为 0.32%，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购总金额} = 100,000 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 0.32\%) = 99,681.02 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 99,681.02 = 318.98 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = (100,000 - 318.98) / 1.040 = 95,847.13 \text{ 份}$$

即：该养老金客户资 100,000 元通过基金管理人的直销柜台申购本基金的 A 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 95,847.13 份 A 类基金份额。

(b) 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：

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

例三：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。

(c) 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

例四：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，赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付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：

赎回费率	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

上表中的“年”指的是 365 个自然日。

(4) 赎回金额的计算

(a) 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

例五：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 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。

#### (b) 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

例六：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。

#### (c) 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

例七：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=125,000.00 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 125,000.00 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、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](http://www.fund001.com)，[www.bocomschroder.com](http://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。

#### (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:

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 1.010 = 101,000 \text{ 元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 101,000 \times 0.5\% = 505 \text{ 元}$$

$$\text{转入确认金额} = 101,000 - 505 = 100,495 \text{ 元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 100,495 \times 0 / (1+0) = 0 \text{ 元}$$

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

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:

$$\text{转出确认金额} = 1,000,000 \times 1.0200 = 1,020,000 \text{ 元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 1,020,000 \times 0.05\% = 510 \text{ 元}$$

$$\text{转入确认金额} = 1,020,000 - 510 = 1,019,490 \text{ 元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 1,019,490 \times 0.5\% / (1+0.5\%) = 5,072.09 \text{ 元}$$

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

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：

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

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

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

转出与转入基金的申购补差费= $124,750 \times 0 = 0$  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= $100,000 \times 1.250 = 125,000$  元

转出基金的赎回费= $125,000 \times 0.2\% = 250$  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= $124,750 \times 1.2\% = 1497$  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= $100,000 \times 0.850 = 85,000$  元

转出基金的赎回费= $85,000 \times 0 = 0$  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= $85,000 \times 0.2\% = 170$  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= $100,000 \times 1.00 = 100,000$  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) 网上直销的有关费率

本基金管理人已开通基金网上直销业务, 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本基金 B 类基金份额的认/申购业务, 通过转托管转入网上直销账户的本基金 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交易平台申购、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。

(8) 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式, 并最迟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况下根据市场情况制定基金促销计划, 针对投资人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, 对投资人适当

调低基金申购费率、赎回费率和转换费率。

### (三) 不列入基金费用的项目

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；
- 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) 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率等相关费率。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率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒体上刊登公告。

### (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

- (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 6 月 30 日。
- (六) 更新了“十一、基金的业绩”中相关内容，数据截止到 2015 年 6 月 30 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”中相关内容。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一五年九月十一日