

交银施罗德增强收益债券型证券投资基金（更新）招募说明书摘要

（2017 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：中国建设银行股份有限公司

二〇一七年六月

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】

交银施罗德增强收益债券型证券投资基金（以下简称本基金）为根据《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后转型而来。交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金经 2013 年 2 月 16 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]150 号文核准募集，自 2013 年 11 月 25 日至 2013 年 12 月 20 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理基金备案手续。经中国证监会书面确认，《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 25 日生效。

交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金第一个保本周期于 2016 年 12 月 26 日到期。按照《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，该基金保本周期到期后转型为非保本的债券型基金，名称相应变更为交银施罗德增强收益债券型证券投资基金。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书根据本基金的基金合同编写，本基金的基金合同经中国证监会备案，但中国证监会对交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金募集的核准以及其转型为本基金的备案，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；本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为债券型证券投资基金，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，属于证券投资基金中中等风险品种。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不代表未来表现。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法律规定享有权利、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 2017 年 6 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 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：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-22 楼

邮政编码：200120

法定代表人：于亚利

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：郭佳敏

电话：（021）61055793

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，董事长，硕士学位。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。

陈朝灯先生，副董事长，博士学位。现任施罗德证券投资信托股份有限公司投资总监兼专户管理部主管。历任复华证券投资信托股份有限公司专户投资经理，景顺证券投资信托股份有限公司部门主管、投资总监。

阮红女士，董事，总经理，博士学位，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。

徐瀚先生，董事，硕士学位。现任交通银行个人金融业务部总经理。历任交通银行香港分行电脑中心副总经理，交通银行信息技术部副总经理，交通银行太平洋信用卡中心副首席执行官、首席执行官。

孙培基先生，董事，学士学位。现任交通银行上海分行党委委员、纪委书记。历任交通银行风险管理部副总经理、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。

李定邦先生，董事，硕士学位，现任施罗德集团亚太区行政总裁。历任施罗德投资管理有限公司亚洲投资产品总监，施罗德投资管理（香港）有限公司行政总裁兼亚太区基金业务拓展总监。

谢丹阳先生，独立董事，博士学位。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，博士学位。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，博士学位。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。现任交通银行战略投资部总经理。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-

KAPITIINTERNATIONALLIMITED，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。

张玲菡女士，监事、学士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司市场总监。历任中国银行福州分行客户经理，新华人寿保险公司上海分公司区域经理，银河基金管理有限公司市场部渠道经理，交银施罗德基金管理有限公司渠道经理、渠道部副总经理、广州分公司副总经理、营销管理部总经理。

余川女士，监事、硕士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司投资运营总监。历任华泰证券股份有限公司综合发展部经理、投资银行部项目经理，银河基金管理有限公司监察部总监，交银施罗德基金管理有限公司监察稽核部总经理、监察风控副总监。

3、基金管理人高级管理人员

阮红女士，总经理。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；交通银行资产托管业务中心副总裁；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。

印皓女士，副总经理，本科学历、硕士学位。历任交通银行研究开发部副主管体改规划员，交通银行市场营销部副主管市场规划员、主管市场规划员，交通银行公司业务部副高级经理、高级经理，交通银行机构业务部高级经理、总经理助理、副总经理。

4、本基金基金经理

于海颖女士，天津大学数量经济学硕士、经济学学士，11年证券投资从业经验。2004年至2006年任北方国际信托投资股份有限公司固定收益研究员，2006年至2010年任光大保德信基金管理有限公司交易员、基金经理助理、基金经理，2010年至2014年任银华基金管理有限公司基金经理，2014年至2016年任五矿证券有限公司固定收益事业部投资管理部总经理。于2007年11月9日至2010年8月30日任光大保德信货币市场基金基金经理，2008年10月29日至2010年8月30日任光大保德信增利收益债券型证券投资

资基金基金经理，2011年6月28日至2013年6月16日任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，2011年8月2日至2014年4月24日任银华货币市场证券投资基金基金经理，2012年8月9日至2014年10月7日任银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）基金经理，2013年4月1日至2014年4月24日任银华交易型货币市场基金基金经理，2013年8月7日至2014年10月7日任银华信用四季红债券型证券投资基金基金经理，2013年9月18日至2014年10月7日任银华信用季季红债券型证券投资基金基金经理，2014年5月8日至2014年10月7日任银华信用债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2016年加入交银施罗德基金管理有限公司，任固定收益（公募）投资总监，2016年12月29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，2017年6月10日起担任交银施罗德增利债券证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金、交银施罗德增强收益债券型证券投资基金、交银施罗德强化回报债券型证券投资基金、交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金、交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金、交银施罗德增利增强债券型证券投资基金基金经理至今。

历任基金经理

孙超先生，2015年11月7日至2017年6月21日任本基金基金经理。

章妍女士，2015年11月21日至2017年3月30日任本基金基金经理。

项廷锋先生，2013年12月25日至2015年10月6日任本基金基金经理。

注：李娜女士于2015年10月7日至2015年11月6日期间代为履行本基金基金经理职责。

5、投资决策委员会成员

委员：阮红（总经理）

王少成（权益投资总监、基金经理）

齐皓（跨境投资总监、投资经理）

于海颖（固定收益（公募）投资总监、基金经理）

张鸿羽（研究部总经理）

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2017年6月25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

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

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

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)67595096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

资产负债稳步增长。2016年末，本集团资产总额20.96万亿元，较上年增加2.61万亿元，增幅14.25%，其中客户贷款总额11.76万亿元，较上年增加1.27万亿元，增幅12.13%。负债总额19.37万亿元，较上年

增加 2.47 万亿元，增幅 14.61%，其中客户存款总额 15.40 万亿元，较上年增加 1.73 万亿元，增幅 12.69%。

核心财务指标表现良好。积极消化五次降息、利率市场化等因素影响，本集团实现净利润 2,323.89 亿元，较上年增长 1.53%。手续费及佣金净收入 1,185.09 亿元，在营业收入中的占比较上年提升 0.83 个百分点。平均资产回报率 1.18%，加权平均净资产收益率 15.44%，净利息收益率 2.20%，成本收入比为 27.49%，资本充足率 14.94%，均居同业领先水平。

2016 年，本集团先后获得国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。荣获《欧洲货币》2016 中国最佳银行，《环球金融》2016 中国最佳消费者银行、2016 亚太区最佳流动性管理银行，《机构投资者》人民币国际化服务钻石奖，《亚洲银行家》中国最佳大型零售银行奖及中国银行业协会年度最具社会责任金融机构奖。本集团在英国《银行家》2016 年世界银行 1000 强排名中，以一级资本总额继续位列全球第 2；在美国《财富》2016 年世界 500 强排名第 22 位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原珂，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持以客户为中心的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2017 年一季度末，中国建设银行已托管 719 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》中国最佳托管银行、中国最佳次托管银行、最佳托管专家 QFII 等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家最佳托管银行。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，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。

（二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、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；业务管理严格实行复核、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

（一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的新一代托管应用监督子系统，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（二）监督流程

- 1.每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。
- 2.收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。
- 3.根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。
- 4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

本基金直销机构为本公司直销柜台以及本公司的网上直销交易平台（网站及 APP，下同）。

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 8 号国金中心二期 21-22 楼

法定代表人：于亚利

成立时间：2005 年 8 月 4 日

电话：（021）61055724

传真：（021）61055054

联系人：傅鲸

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、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、除基金管理人以外的其他销售机构

（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：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

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 9 号

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人: 常振明

电话: (010) 89936330

传真: (010) 85230024

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: 陈震山

电话: (0571) 85108195、85120696

传真: (0571) 86475527

联系人: 严峻、夏帆

客户服务电话: 96523

网址: www.hzbank.com.cn

(7) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

住所: 江苏省常州市和平中路 413 号

办公地址: 江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人: 陆向阳

电话: 0519-80585939

传真: 0519-89995170

联系人: 蒋姣

客户服务电话: 96005

网址: <http://www.jnbank.com.cn>

(8) 东莞农村商业银行股份有限公司

住所: 东莞市东城区鸿福东路 2 号

办公地址: 东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人: 何沛良

电话: (0769) 22866254

传真: (0769) 22866282

联系人: 林培珊

客户服务电话: (0769) 961122

网址: www.drcbank.com

(9) 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

(10) 平安证券股份有限公司

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

(11) 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

（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：陈有安

电话：（010）66568292

联系人：邓颜

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

（13）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

（14）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

（15）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

（16）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：王少华

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（17）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

（18）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

（19）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

（20）中泰证券股份有限公司

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：许曼华

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

（21）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

（22）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

（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

（24）国金证券股份有限公司

住所：四川省成都市东城根上街 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）86690057，（028）86690058

传真：（028）86690126

联系人：刘婧漪贾鹏

客户服务电话：95310

网址：www.gjzq.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：天津市南开区滨水西道 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

（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：张志刚

电话：（010）63081000

传真：（010）63081344

联系人：尹旭航

客户服务电话：95321

网址：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

（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

（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

（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

（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

（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

（33）中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层
办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层
法定代表人：张皓
电话：（0755）23953913
传真：（0755）83217421
联系人：洪诚
客户服务电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com

（34）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 218 号 1 幢 202 室
办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6 楼
法定代表人：陈柏青
电话：（0571）81119792
传真：（0571）22905999
联系人：韩爱彬
客户服务电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn

（35）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

（36）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：单丙烨
客户服务电话：400-820-2899
网址：www.erichfund.com

(37) 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

(38) 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

(39) 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/>

(40) 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

(41) 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

(42) 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/>

(43) 北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

电话：(010) 59601366-7024

传真：(010) 62020355

联系人：马林

客户服务电话：400-888-6661

网址：www.myfund.com

(44) 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/>

(45) 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：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼

法定代表人：燕斌

电话：021-52822063

传真：021-52975270

联系人：凌秋艳

客户服务电话：4000-466-788

网址：www.66zichan.com

(46) 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

(47) 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：www.5ifund.com

(48) 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

(49) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

法定代表人：林卓

电话：(0411) 88891212

传真：(0411) 84396536

联系人：薛长平

客户服务电话：4006411999

网址：www.taichengcaifu.com

(50) 上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)

办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室

法定代表人：王翔

电话：(021) 65370077

传真：(021) 55085991

联系人：俞申莉

客户服务电话：(021) 65370077

网址：<http://www.fofund.com.cn/>

(51) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法定代表人：肖雯

电话：(020) 89629099

传真：(020) 89629011

联系人：黄敏嫦

客户服务电话：（020）89629066

网址：www.yingmi.cn

（52）深圳富济财富管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室

法定代表人：齐小贺

电话：（0755）83999907-802

传真：（0755）83999926

联系人：马力佳

客户服务电话：（0755）83999907

网址：www.jinqianwo.com

（53）上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

电话：（021）20665952

传真：（021）22066653

联系人：宁博宇

客户服务电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

（54）上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

办公地址：上海市虹梅路1801号凯科国际大厦7楼

法定代表人：冯修敏

电话：（021）33323999

传真：（021）33323837

联系人：陈云卉

客户服务电话：4008213999

网址：<https://tty.chinapnr.com>

（55）北京虹点基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人：胡伟

电话：（010）65951887

传真：（010）65951887

联系人：姜颖

客户服务电话：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com/

（56）上海凯石财富基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武

电话：021-63333319

传真：021-63332523

联系人：李晓明

客服电话：4000178000

网址：www.lingxianfund.com

(57) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

电话：021-50583533

传真：021-50583633

联系人：徐鹏

客服电话：400-005-6355

网址：a.leadfund.com.cn

(58) 大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

电话：(025) 68206846

传真：(021) 22268089

联系人：何庭宇

客户服务电话：400-928-2266/021-22267995

网址：www.dtfunds.com

(59) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

电话：(010) 56282140

传真：(010) 62680827

联系人：丁向坤

客户服务电话：400-619-9059

网址：www.fundzone.cn、www.51jijinhui.com

(60) 北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：李悦

电话：(010) 56642600

传真：(010) 56642623

联系人：张晔

客户服务电话：4007868868

网址：www.chtfund.com

(61) 北京广源达信投资管理有限公司

住所：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

电话：(010) 57298634

传真：（010）82055860

联系人：王英俊

客户服务电话：400-623-6060

网址：www.niuniufund.com

（62）奕丰金融服务（深圳）有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室

法定代表人：TANYIKKUAN

电话：（0755）89460500

传真：（0755）21674453

联系人：叶健

客户服务电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

（63）浙江金观诚财富管理有限公司

住所：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：徐黎云

电话：（0571）88337717

传真：（0571）88337666

联系人：孙成岩

客户服务电话：400-068-0058

网址：www.jincheng-fund.com

（64）北京创金启富投资管理有限公司

住所：北京市西城区民丰胡同31号中水大厦215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社A综合楼712室

法定代表人：梁蓉

电话：（010）66154828

传真：（010）63583991

联系人：李婷婷

客户服务电话：400-6262-818

网址：www.5irich.com

（65）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

电话：（010）59336533

传真：（010）59336500

联系人：孟汉霄

客户服务电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

（66）上海云湾投资管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层，200127

办公地址：上海市锦康路308号6号楼6层

法定代表人：戴新装

电话：（021）20538888

传真：（021）20538999

联系人：江辉

客户服务电话：400-820-1515

网址：www.zhengtongfunds.com

（67）乾道金融信息服务（北京）有限公司

住所：北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室

法定代表人：王兴吉

电话：（010）62062880

传真：（010）82057741

联系人：高雪超

客户服务电话：4000-888-080

网址：www.qiandaojr.com

（68）北京肯特瑞财富管理有限公司

住所：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部

法定代表人：陈超

电话：4000988511，4000888816

传真：（010）89188000

联系人：赵德赛

客户服务电话：4000988511，4000888816

网址：<http://fund.jd.com/>

（69）北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

法定代表人：李昭琛

电话：（010）60619607

传真：8610-62676582

联系人：付文红

客户服务电话：（010）62675369

网址：www.xincai.com

（70）杭州科地瑞富基金销售有限公司

住所：杭州市下城区武林时代商务中心1604室

办公地址：杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼

法定代表人：陈刚

电话：（0571）85267500

传真：（0571）85269200

联系人：胡璇

客户服务电话：（0571）86655920

网址：www.cd121.com

（71）北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区望京SOHO塔2B座2507

法定代表人：钟斐斐

电话：（010）61860688

传真：（010）61840699

联系人：戚晓强

客户服务电话：400-0618-518

网址：<https://danjuanapp.com/>

（72）凤凰金信（银川）投资管理有限公司

住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402(750000)

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院朝来高科技产业园 18 号楼(100000)

法定代表人：程刚

电话：（010）58160168

传真：（010）58160173

联系人：张旭

客户服务电话：400-810-5919

网址：www.fengfd.com

（73）深圳市金斧子基金销售有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人：赖任军

电话：（0755）66892301

传真：（0755）66892399

联系人：张烨

客户服务电话：400-9500-888

网址：www.jfzinv.com

（74）上海朝阳永续基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室

办公地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法定代表人：廖冰

电话：（021）80234888

传真：（021）80234898

客户服务电话：400-699-1888

网址：www.998fund.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）50938617

传真：（010）50938907

联系人：周莉

（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

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：朱宏宇

经办注册会计师：薛竞、朱宏宇

四、基金的名称

本基金名称：交银施罗德增强收益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

在严格控制投资风险的基础上，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，包括国内依法公开发行交易的债券、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币市场工具、权证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，但需符合中国证监会的相关规定。

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。

本基金的投资组合比例为：固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%，固定收益类资产包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、次级债、债券回购等金融工具；股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不高于 20%；现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金将依据宏观经济数据和金融运行数据、货币政策、财政政策、以及债券市场和股票市场风险收益特征，分析判断市场利率水平变动趋势和股票市场走势。并根据宏观经济、基准利率水平、股票市场整体估值水平，预测债券、可转债、新股申购等大类资产下一阶段的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。

2、债券投资策略

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。

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

本基金通过灵活的久期管理策略自上而下的控制利率风险。在全球经济的框架下，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计划投资目标，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，本计划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

信用债券同时承载了利率风险与信用风险，而信用风险对信用债券表现的影响胜于利率风险。具体而言，本基金信用债券的投资遵循以下流程：

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。

信用债券投资

本基金从信用债券池中精选债券构建信用债券投资组合，主要考虑以下因素：

- a. 信用债券信用评级的变化。

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。

(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。

(8) 可转换债券投资策略

可转换债券是介于股票和债券之间的投资品种，兼具股性和债性的双重特征。

本基金对于可转换债券股性的研究将完全依托于基金管理人对其股票的研究，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。

对于本基金可转换债券债性的研究，将引进基金管理人的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

本基金通过对股票市场的适度投资，进一步强化投资组合的收益获取能力，提高组合的预期收益水平。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运行和行业景气变化、以及上市公司成长潜力的基础上，采取定量分析与定性分析相结合的方法，通过优选具有良好成长性、质量优良、定价相对合理的股票进行投资，在保证组合安全边际的前提下力求获得超额收益，增强基金整体收益。

4、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证的收益性、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。

九、基金的业绩比较标准

本基金的整体业绩比较基准采用：

90%中证综合债券指数收益率+10%沪深 300 指数收益率

中证综合债券指数是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场国债、金融债、企业债、央行票据及短期融资券整体走势的跨市场债券指数，该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，具有较强的市场代表性。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

沪深 300 指数是由上海和深圳证券市场中选取 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，投资人可以方便地从报纸、互联网等财经媒介中获取。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。

本基金的业绩比较基准按照本基金的目标资产配置比例来安排中证综合债券指数收益率与沪深 300 指数收益率的配比，以其作为本基金的业绩比较基准能比较贴切体现和衡量本基金的投资目标、投资策略以及投资业绩。

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经与本基金托管人协商同意后调整业绩比较基准，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

本基金为债券型证券投资基金，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，属于证券投资基金中的中等风险品种。

十一、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 4 月 21 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 3 月 31 日。本报告财务资料未经审计。

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 60,877,312.40 96.06

其中：债券 60,877,312.40 96.06

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 1,386,865.12 2.19

7 其他资产 1,110,682.91 1.75

8 合计 63,374,860.43 100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

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 5,566,312.40 10.09

2 央行票据 --

3 金融债券 --

其中：政策性金融债 --

4 企业债券 14,851,500.00 26.92

5 企业短期融资券 --

6 中期票据 40,459,500.00 73.33

7 可转债（可交换债） --

8 同业存单 --
9 其他 --
10 合计 60,877,312.40 110.34

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 019546 16 国债 18 55,730 5,566,312.40 10.09
2 101461018 14 株城发 MTN001 50,000 5,269,000.00 9.55
3 101554011 15 淄博城运 MTN001 50,000 5,140,500.00 9.32
4 101354002 13 桂机场 MTN001 50,000 5,095,000.00 9.23
5 101551028 15 华侨城 MTN001 50,000 5,085,000.00 9.22

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 16 华泰 G3 (证券代码: 136873) 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 16 华泰 G3 (证券代码: 136873) 的发行主体华泰证券于 2016 年 11 月 29 日公告, 公司因未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为于 2016 年 11 月 28 日收到中国证监会《行政处罚决定书》([2016]126 号)。据此, 中国证监会决定对公司责令改正, 给予警告, 没收违法所得 18,235,275.00 元, 并处以 54,705,825.00 元罚款。

本基金管理人对该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。本基金在对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上, 严格执行公司个券审核流程。在对该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, 所以不影响对该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	30,455.96
2 应收证券清算款	-
3 应收股利	-
4 应收利息	1,078,234.91
5 应收申购款	1,992.04
6 其他应收款	-
7 待摊费用	-
8 其他	-
9 合计	1,110,682.91

(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
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 2017 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

(1) 交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
----	-------	----------	-----------	--------------

过去三个月	-0.24%	0.06%	0.32%	0.08%
-------	--------	-------	-------	-------

2016 年度（自基金转型日起至 2016 年 12 月 31 日）	0.08%	0.06%	0.21%	0.15%
------------------------------------	-------	-------	-------	-------

注：交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金从 2016 年 12 月 30 日起正式转型为交银施罗德增强收益债券型证券投资基金，本表列示的是本报告期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 90%中证综合债券指数收益率+10%沪深 300 指数收益率。

(2) 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
----	---------	------------	-----------	--------------

2016 年 10 月 1 日至 2016 年 12 月 29 日	1.60%	0.12%	0.69%	0.01%
-----------------------------------	-------	-------	-------	-------

2016 年 7 月 1 日至 2016 年 12 月 29 日	3.00%	0.14%	1.39%	0.01%
----------------------------------	-------	-------	-------	-------

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 29 日	-0.24%	0.26%	2.78%	0.01%
----------------------------------	--------	-------	-------	-------

2014 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 29 日	42.79%	0.63%	10.47%	0.01%
----------------------------------	--------	-------	--------	-------

自基金合同生效起至 2016 年 12 月 29 日	42.94%	0.62%	10.55%	0.01%
----------------------------	--------	-------	--------	-------

注：交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金从 2016 年 12 月 30 日起正式转型为交银施罗德增强收益债券型证券投资基金，本表列示的是本报告期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税后收益率。

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

(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

交银施罗德增强收益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历史走势对比图

(2016 年 12 月 30 日至 2017 年 3 月 31 日)

注：本基金由交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日为 2016 年 12 月 30 日，基金转型日至报告期期末，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荣泰保本混合型证券投资基金保本周期到期期间截止日的次日（即 2016 年 12 月 30 日）起的 3 个月。截至投资转型期结束，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) 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

交银施罗德荣泰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的历史走势对比图

(2013 年 12 月 25 日至 2016 年 12 月 29 日)

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、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：

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

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

(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：

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

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

(3) 上述一、基金费用的种类中第 3—9 项费用，根据有关法律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。

投资人可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算，申购费率如下：

申购金额（含申购费） 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

投资人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。

本基金对通过基金管理人直销柜台申购本基金的养老金客户实施特定申购费率。

养老金客户指基本养老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：

- 1) 全国社会保障基金；
- 2) 可以投资基金的地方社会保障基金；
- 3) 企业年金单一计划以及集合计划；
- 4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；
- 5) 企业年金养老金产品。

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，基金管理人可在招募说明书更新或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的养老金客户特定申购费率如下表：

申购费率 申购金额（含申购费） 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

(2) 申购份额的计算

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

例一:某投资者(非养老金客户)投资100,000元申购本基金(非网上交易),假设申购当日基金份额净值为1.040元,申购费率为0.8%,则其可得到的申购份额为:

申购总金额=100,000元

净申购金额=100,000/(1+0.8%)=99,206.35元

申购费用=100,000-99,206.35=793.65元

申购份额=(100,000-793.65)/1.040=95,390.72份

即:某投资者(非养老金客户)投资100,000元申购本基金(非网上交易),假设申购当日基金份额净值为1.040元,则其可得到95,390.72份基金份额。

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,假设申购当日基金份额净值为1.040元,申购费率为0.32%,则其可得到的申购份额为:

申购总金额=100,000元

净申购金额=100,000/(1+0.32%)=99,681.02元

申购费用=100,000-99,681.02=318.98元

申购份额=(100,000-318.98)/1.040=95,847.13份

即:该养老金客户投资100,000元通过基金管理人的直销柜台申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.040元,则其可得到95,847.13份基金份额。

(3) 赎回费用

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

赎回费率随基金份额的持有时间递减,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

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:某投资者在持有期限少于一年时赎回100,000份基金份额,对应的赎回费率为0.1%,假设赎回当日基金份额净值是1.016元,则其可得到的赎回金额为:

赎回费用=100,000×1.016×0.1%=101.60元

赎回金额=100,000×1.016-101.60=101,498.40元

即:投资者在持有期限少于一年时赎回100,000份基金份额,对应的赎回费率为0.1%,假设赎回当日基金份额净值是1.016元,则其可得到的赎回金额为101,498.40元。

(5) 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、本基金基金份额的申购、赎回、定期定额投资等业务。通过网上直销交易平台办理本基金申购业务的个人投资者将享受申购费率优惠,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基金份额的单笔最低金额为 10 元（含），单笔定期定额投资最低金额为 10 元（含）。

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。

（6）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）更新了八、基金的投资中基金投资组合报告相关内容，数据截止到 2017 年 3 月 31 日。
- （六）更新了九、基金的业绩中相关内容，数据截止到 2017 年 3 月 31 日。
- （七）更新了二十一、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

二〇一七年八月九日