



交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券 投资基金 (更新) 招募说明书摘要

(2014 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：中国建设银行股份有限公司

二〇一四年十二月

【重要提示】

交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2010 年 5 月 12 日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】624 号文核准募集。本基金基金合同于 2010 年 6 月 30 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：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

投资有风险，投资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其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、

基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2014 年 12 月 30 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2014 年 9 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：钱文挥

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

钱文挥先生，董事长及代任总经理，硕士学历。现任交通银行股份有限公司执行董事，副行长。历任中国建设银行资产负债管理委员会办公室主任兼上海分行副行长、资产负债管理委员会办公室主任兼体制改革办公室主任兼上海分行副行长、资产负债管理部总经理、资产负债管理部总经理兼重组改制办公室主任、交通银行股份有限公司副行长兼上海分行行长。

雷贤达先生，副董事长，学士学历，加拿大证券学院和香港证券学院荣誉院士。历任巴克莱基金管理有限公司基金经理、施罗德投资管理（香港）有限公司执行董事、交银施罗德基金管理有限公司总经理。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员。

阮红女士，董事，博士学历。现任交通银行投资管理部总经理。历任交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长、办公室综合处处长、交通银行海外机构管理部副总经理、总经理、交通银行上海分行副行长、交通银行资产托管部总经理。

吴伟先生，董事，博士学历。现任交通银行投资银行业务中心总裁。历任交通银行总行财会部财务处主管、副处长、预算财务部副总经理、总经理，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院长。历任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任。

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

杜静先生，监事长，硕士学位，高级经济师。历任中国农业银行潜江支行办公室副主任；交通银行武汉分行信贷处副处长、信贷处处长兼授信催理处主任、国外业务处处长；交通银行市场营销部业务代理处处长；交通银行宜昌分行党委书记、行长；交通银行福建省分行党委书记、行长；交通银行华中授信审批中心总经理。

裴关淑仪女士，监事，CFA、CIPM、FRM，工商管理、资讯管理双硕士。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监事会办公室总经理兼董事会秘书。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。

3、公司高管人员

钱文挥先生，董事长及代任总经理。钱文挥先生代为履行总经理职务的时间自 2014 年 12 月 29 日起，不超过 90 日。简历同上。

苏奋先生，督察长，纽约城市大学工商管理硕士。历任交通银行广州分行市场营销部总经理助理、副总经理，交通银行纽约分行信贷管理部经理、公司金融部经理、信用风险管理办公室负责人，交通银行投资管理部投资并购高级经理，交银施罗德基金管理有限公司综合管理部总监。

许珊燕女士，副总经理，硕士学历，高级经济师，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。

谢卫先生，副总经理，经济学博士，高级经济师。历任中央财经大学金融系教员；中国社会科学院财经所助理研究员；中国电力信托投资公司基金部副经理；中国人保信托投资公司证券部副总经理、总经理、北京证券营业部总经理、证券总部副总经理兼北方部总经理，富国基金管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

李永兴先生，基金经理。北京大学理学学士和经济学硕士。8 年基金从业经验。2006 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任研究部研究员、基金经理助理。2012 年 3 月 20 日起担任本基金基金经理至今，2014 年 5 月 22 日起担任交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理至今。

历任基金经理：

史伟先生，2010 年 6 月 30 日至 2013 年 6 月 6 日担任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

委员：项廷锋（投资总监、基金经理）

杨利平（投资总监）

管华雨（权益投资总监、基金经理）

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 2014 年 12 月 30 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)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的历史经营历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

2014 年上半年，本集团实现利润总额 1,695.16 亿元，较上年同期增长 9.23%；净利润 1,309.70 亿元，较上年同期增长 9.17%。营业收入 2,870.97 亿元，较上年同期增长 14.20%；其中，利息净收入增长 12.59%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入增长 8.39%，在营业收入中的占比达 20.96%。成本收入比 24.17%，同比下降 0.45 个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为 13.89%和 11.21%，同业领先。

截至 2014 年 6 月末，本集团资产总额 163,997.90 亿元，较上年末增长 6.75%，其中，客户贷款和垫款总额 91,906.01 亿元，增长 6.99%；负债总额 152,527.78 亿元，较上年末增长 6.75%，其中，客户存款总额 129,569.56 亿元，增长 6.00%。

截至 2014 年 6 月末，中国建设银行公司机构客户 326.89 万户，较上年末增加 20.35 万户，增长 6.64%；个人客户近 3 亿户，较上年末增加 921 万户，增长 3.17%；网上银行客户 1.67 亿户，较上年末增长 9.23%，手机银行客户数 1.31 亿户，增长 12.56%。

截至 2014 年 6 月末，中国建设银行境内营业机构总量 14,707 个，服务覆盖面进一步扩大；自助设备 72,128 台，较上年末增加 3,115 台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 86.55%，较上年末提高 1.15 个百分点。

2014 年上半年, 本集团各方面良好表现, 得到市场与业界广泛认可, 先后荣获国内外知名机构授予的 40 余个重要奖项。在英国《银行家》杂志 2014 年“世界银行 1000 强排名”中, 以一级资本总额位列全球第 2, 较上年上升 3 位; 在美国《福布斯》杂志 2014 年全球上市公司 2000 强排名中位列第 2; 在美国《财富》杂志世界 500 强排名第 38 位, 较上年上升 12 位。

中国建设银行总行设投资托管业务部, 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、监督稽核处等 9 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 240 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。

2、主要人员情况

赵观甫, 投资托管业务部总经理, 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。

纪伟, 投资托管业务部副总经理, 曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部, 长期从事大客户的客户管理及服务工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红, 投资托管业务部副总经理, 曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室, 长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲, 投资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。

3、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、QFII、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 2014 年 9 月末，中国建设银行已托管 389 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。中国建设银行自 2009 年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

(二) 基金托管人的内部控制制度

1、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。

2、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。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

投资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

1、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“托管业务综合系统——基金监督子系统”，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，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。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。

2、监督流程

(1) 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(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、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，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：钱文挥

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、代销机构

场外代销机构

(1) 中国工商银行股份有限公司

住所: 北京市复兴门内大街 55 号

办公地址: 北京市复兴门内大街 55 号

法定代表人: 姜建清

客户服务电话: 95588

网址: www.icbc.com.cn

(2) 中国农业银行股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人: 蒋超良

传真: (010) 85109219

客户服务电话: 95599

网址: www.abchina.com

(3) 中国建设银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 王洪章

电话: (010) 66275654

传真: (010) 66275654

客户服务电话: 95533

网址: www.ccb.com

(4) 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

(5) 招商银行股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：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

(6) 上海银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 168 号

办公地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

电话：(021) 68475888

传真：(021) 68476111

联系人：张萍

客户服务电话：(021) 962888

网址：www.bankofshanghai.com

(7) 广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

联系人: 李晓鹏

客户服务电话: 800-830-8003, 400-830-8003

网址: www.gdb.com.cn

(8) 中信银行股份有限公司

住所: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人: 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

(9) 中国民生银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人: 董文标

电话: (010) 57092615

传真: (010) 57092611

联系人: 董云巍

客户服务电话: 95568

网址: www.cmbc.com.cn

(10) 中国光大银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址: 北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人: 唐双宁

电话: (010) 68098778

传真: (010) 68560661

联系人: 李伟

客户服务电话: 95595

网址: www.cebbank.com

(11) 宁波银行股份有限公司

住所: 宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人: 陆华裕

电话: (021) 63586210

传真: (021) 63586215

联系人: 胡技勋

客户服务电话: 96528 (上海地区 962528)

网址: www.nbc.com.cn

(12) 北京银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址: 北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人: 闫冰竹

电话: (010) 66223584

传真: (010) 66226045

联系人: 谢小华

客户服务电话: 95526

网址: www.bankofbeijing.com.cn

(13) 平安银行股份有限公司

住所: 广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址: 广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人: 肖遂宁

电话: (0755) 82088888

联系人: 张青

客户服务电话: 95501

网址: www.sdb.com.cn

(14) 江苏银行股份有限公司

住所: 南京市洪武北路 55 号

办公地址: 南京市洪武北路 55 号

法定代表人：黄志伟

电话：(025) 58587018

传真：(025) 58587038

联系人：田春慧

客户服务电话：96098, 40086-96098

网址：www.jsbchina.cn

(15) 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

(16) 华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴健

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(17) 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

(18) 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

(19) 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

(20) 中信建投证券股份有限公司

住所: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人: 张佑君

电话: (010) 85130588

传真: (010) 65182261

联系人: 魏明

客户服务电话: 4008-888-108

网址: www.csc108.com

(21) 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

(22) 广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

传真：(020) 87555305

联系人：肖中梅

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

网址：www.gf.com.cn

(23) 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

(24) 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

(25) 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

(26) 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

(27) 申银万国证券股份有限公司

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 40 层

法定代表人: 储晓明

电话: (021) 33389888

联系人: 李清怡

客户服务电话: 95523 或 4008895523

网址: www.sywg.com

(28) 湘财证券有限责任公司

住所: 湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼

法定代表人: 林俊波

电话: (021) 68634518

传真: (021) 68865680

联系人: 钟康莺

客户服务电话: 400-888-1551

网址: www.xcsc.com

(29) 国都证券有限责任公司

住所: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人: 常喆

客户服务电话: 400-818-8118

网址: www.guodu.com

(30) 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

(31) 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

(32) 中银国际证券有限责任公司

住所: 上海市银城中路 200 号 39 层

办公地址: 中国上海浦东银城中路 200 号中银大厦 39-40 层

法定代表人: 许刚

联系人: 李丹

客户服务电话: 400-620-8888

网址: www.bocichina.com

(33) 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

(34) 恒泰证券股份有限公司

住所: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人: 庞介民

电话: (0471) 4979037

传真: (0471) 4961259

联系人: 王旭华

客户服务电话: (0471) 4960762, (021) 68405273

网址: www.cnht.com.cn

(35) 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

(36) 国元证券股份有限公司

住所: 安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址: 安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人: 凤良志

客户服务电话: 400-8888-777

网址: www.gyzq.com.cn

(37) 东北证券股份有限公司

住所: 长春市自由大路 1138 号

办公地址: 长春市自由大路 1138 号

法定代表人: 矫正中

电话: (0431) 85096709

联系人: 潘锴

客户服务电话: 4006000686, (0431) 85096733

网址: www.nesc.cn

(38) 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

(39) 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

(40) 宏源证券股份有限公司

住所: 新疆乌鲁木齐市建设路 2 号

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 19 号宏源证券

法定代表人: 冯戎

电话: (010) 88085858

传真: (010) 88085195

联系人: 李巍

客户服务电话: 4008-000-562

网址: www.hysec.com

(41) 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

(42) 德邦证券有限责任公司

住所: 上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址: 上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人: 姚文平

电话: (021) 68761616

传真: (021) 68767981

客户服务电话: 4008-888-128

网址: www.tebon.com.cn

(43) 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

(44) 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

(45) 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

(46) 厦门证券有限公司

住所：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

法定代表人：傅毅辉

电话：(0592) 5161642

传真：(0592) 5161640

联系人：赵钦

客户服务电话：(0592) 5163588

网址：www.xmzq.cn

(47) 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

(48) 中国国际金融有限公司

住所：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：金立群

电话：(010) 65051166

传真：(010) 65058065

联系人：罗春蓉、武明明

网址：www.cicc.com.cn

(49) 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

(50) 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

(51) 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

(52) 中国民族证券有限责任公司

住所: 北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

办公地址: 北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人: 赵大建

客户服务电话: 400-889-5618

网址: www.e5618.com

(53) 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

(54) 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

(55) 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

(56) 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

(57) 东方证券股份有限公司

住所: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人: 王益民

电话: (021) 63325888

传真: (021) 63326173

联系人: 吴宇

客户服务电话: 95503

网址: www.dfzq.com.cn

(58) 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

(59) 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

(60) 东兴证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人: 徐勇力

电话: (010) 66555316

传真: (010) 66555246

联系人: 汤漫川

客户服务电话: 400-8888-993

网址: www.dxzq.net

(61) 华福证券有限责任公司

住所: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址: 福州市五四路新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人: 黄金琳

电话: (0591) 87383623

传真: (0591) 87383610

客户服务电话: (0591) 96326

网址: www.hfzq.com.cn

(62) 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

(63) 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

(64) 中原证券股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号中原广发金融大厦 17 层

法定代表人：菅明军

电话：(0371) 65585670

传真：(0371) 65585665

联系人：程月艳、耿铭

客户服务电话：(0371) 967218, 400-813-9666

网址：www.ccnew.com

(65) 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

(66) 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

(67) 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: 周瑾旻

客户服务电话: 4000-766-123

网址: www.fund123.cn

(68) 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

(69) 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) 20691835

传真：(021) 20691861

联系人：单丙焜

客户服务电话：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

(70) 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

(71) 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

(72) 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/>

(73) 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

(74) 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

(75) 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: <https://t.jrj.com/>

(76) 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

场内代销机构是指由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格, 并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员(以下简称“有资格的上交所会员”), 名单详见上海证券交易所网站。

基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其它符合要求的机构代理销售本基金, 并及时公告。

(二) 注册登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：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：交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金力图通过前瞻性的主题优选，积极把握行业和个股投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力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，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

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。

八、基金的投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济发展趋势、经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整投资组合比例，自上而下灵活配置资产；通过优选主题配置和挖掘预期具有良好增长前景的优势行业相结合的方式，精选个股，以

谋求超额收益。

1、资产配置

本基金将通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合以实现大类资产的灵活配置。具体而言，首先利用经济周期理论，对宏观经济的经济周期进行预测，在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在各类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，以规避或分散市场风险，提高基金收益率。

具体操作中，基金管理人采用经济周期理论下的资产配置模型，通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析，对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测，然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。

根据经济周期理论，一个宏观经济运行的周期可以分为减速、衰退、复苏和扩张四个阶段，在经济周期的不同阶段，通货膨胀、利率水平和货币政策等对金融市场有着重要影响的因素往往表现出不同的规律，从而影响到不同大类金融资产的定价和市场表现。而实证研究也表明，经济周期与金融市场的表现往往呈现出很强的相关性，当宏观经济运行处于不同的阶段时，股票、债券和现金等各大类资产也体现出不同的市场表现。经济周期理论下的资产配置模型依据经济周期和金融市场表现所呈现的相关关系，通过预测宏观经济运行所处的阶段，对各类资产在该阶段下可能的市场表现进行判断，从而为资产配置的调整提供依据。具体而言，首先通过分析 GDP 增长率、失业率、利率水平和通货膨胀率等宏观经济运行指标和货币、财政政策的变化趋势，判断宏观经济运行所处的阶段。然后，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况的实证研究，对股票、债券和现金等大类资产投资的比例进行战略配置和调整，增加该阶段下市场表现优于其他资产类别的资产的配置，减少市场表现相对较差的资产类别的配置，以规避或分散市场风险，提高基金经风险调整后的收益。

2、主题配置

基金管理人认为，发生在 2008 年由次级贷款危机引发的全球性金融危机将为国际化的金融市场、贸易结构乃至各国间国力的此消彼长带来长远而深刻的影响。从经济发展的长期趋势看，此次金融危机的发生为我国提供了改变传统的以

投资外加出口的经济增长模式的历史性机遇。本基金深刻分析在这一机遇与挑战并存的环境中推动我国经济新一轮腾飞和企业跨越式发展的关键性和趋势性因素, 及时把握中国经济崛起过程中的主题投资机会, 自上而下的进行主题发掘。基金管理人认为, 在相当长一段时期内, 内需扩大、消费升级、产业链整合、技术创新将是本轮中国经济腾飞过程中最关键的四大主题, 在相当长一段时期内本基金将重点围绕这四大优选主题进行行业的选择和配置。未来, 随着中国出现新的经济增长模式及新的经济发展趋势等因素的改变, 基金管理人将深入挖掘和把握可能蕴含的更具价值的投资主题, 为基金谋取良好的投资机会。

在各优选主题间进行配置的决策过程中, 本基金将综合考虑宏观经济发展的长期趋势、经济周期、市场变化以及多个优选主题的活跃程度, 对未来市场运行趋势做出预期判断, 综合评价相关经济环境变化对精选的有关主题及受益于该主题的行业和上市公司的影响, 动态调整各主题受益行业和上市公司在股票资产配置中的比重。

3、行业选择和配置

本基金将利用交银施罗德研究体系对多个优选主题所覆盖的细分行业进行预测和分析, 挑选预期具有良好增长前景的行业进行重点投资。

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

基金管理人采用多因素的定性与定量相结合的分析 and 预测方法, 确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响, 得出各行业的相对投资价值与投资时机, 据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业, 把握行业景气轮换带来的投资机会。

具体操作中, 我们对行业的挑选重点分为两个部分, 即行业平均增长率预测和行业综合评价。首先考察各行业历史收入和利润增长表现, 对未来行业收入增长率和行业平均利润增长率进行预测。然后对行业的综合表现和增长空间进行评估和排序, 挑选出未来一段时间内最具增长前景的行业。具体评估将从宏观经济环境(重点包括宏观经济政策、产业政策对相关行业发展的影响)、行业景气度分析和预测(关注上下游行业对本行业景气度影响、密切追踪各行业景气度指标)

、行业财务状况（行业盈利能力、行业经营效率）和行业竞争力综合表现四个方面入手，采用定性分析结合定量分析的方法对行业的未来增长前景进行综合评价。

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

4、股票选择

在前述主题配置和行业优选的基础上，本基金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，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。具体分以下两个层次进行股票挑选：

(1) 品质筛选

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

此外，为了控制中小企业投资的个股风险，对以下股票进行剔除：

- ① *ST 和 ST 公司股票；
- ② 财务资料可信度较低或者财务资料有重大瑕疵的公司股票；
- ③ 有关媒体报道有重大虚假陈述和重大利益输送以及其他重大违规、违法的公司股票。

(2) 多元化价值评估

本基金在前述主题配置和行业优选的基础上，根据下述标准挑选出其中具有投资潜力的上市公司构建核心股票池：

- ① 公司治理结构良好，管理规范，信息透明；
- ② 主营业务鲜明，盈利能力强，收入和利润稳定增长；
- ③ 公司具有质量优良的成长性；
- ④ 公司财务状况良好，具备一定的规模优势和较好的抗风险能力；
- ⑤ 公司在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相当的核心竞争优势，

有良好的市场知名度和较好的品牌效应，处于行业龙头地位。

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

5、债券投资

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

在全球经济的框架下，基金管理人对于宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化作出判断，运用数量化工具，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略和换券等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。

6、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。

7、资产支持证券的投资策略

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

九、基金的业绩比较标准

本基金的整体业绩比较基准采用：

60%×沪深 300 指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率

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, 则基金管理人将视情况经与基金托管人协商同意并履行相关程序后调整本基金的业绩比较基准, 及时公告并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

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

十一、基金投资组合报告

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

本基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定, 于 2014 年 10 月 23 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 2014 年 7 月 1 日至 2014 年 9 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	407,297,951.88	79.18
	其中: 股票	407,297,951.88	79.18
2	固定收益投资	75,799,488.60	14.74
	其中: 债券	75,799,488.60	14.74
	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	30,750,210.24	5.98
7	其他资产	556,606.24	0.11
8	合计	514,404,256.96	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	112,428,807.25	21.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,760,406.64	1.13
E	建筑业	13,284,321.60	2.60
F	批发和零售业	22,364,586.50	4.37
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,987,260.00	0.98
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,112,355.03	4.13
J	金融业	132,037,917.82	25.82
K	房地产业	75,912,976.69	14.84
L	租赁和商务服务业	-	-
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	10,146,683.96	1.98
R	文化、体育和娱乐业	9,262,636.39	1.81
S	综合	-	-

合计	407,297,951.88	79.64
----	----------------	-------

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	600030	中信证券	1,793,100	23,884,092.00	4.67
2	601318	中国平安	545,000	22,530,300.00	4.41
3	600837	海通证券	2,068,336	21,345,227.52	4.17
4	000024	招商地产	1,667,861	20,498,011.69	4.01
5	601555	东吴证券	1,649,781	16,992,744.30	3.32
6	603005	晶方科技	325,599	15,550,608.24	3.04
7	002353	杰瑞股份	391,326	15,253,887.48	2.98
8	000712	锦龙股份	797,600	14,109,544.00	2.76
9	600511	国药股份	506,910	13,661,224.50	2.67
10	000961	中南建设	1,509,582	13,284,321.60	2.60

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	19,998,000.00	3.91
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	55,801,488.60	10.91
8	其他	-	-
9	合计	75,799,488.60	14.82

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	113005	平安转债	227,880	24,941,466.00	4.88
2	110025	国金转债	166,800	20,604,804.00	4.03
3	1080077	10 马建投债	200,000	19,998,000.00	3.91
4	113001	中行转债	49,680	5,144,860.80	1.01
5	113002	工行转债	46,940	5,110,357.80	1.00

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	147,595.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	340,271.21
5	应收申购款	68,739.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	556,606.24

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	24,941,466.00	4.88
2	113001	中行转债	5,144,860.80	1.01
3	113002	工行转债	5,110,357.80	1.00

(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 2014 年 9 月 30 日, 所载财务数据未经审计师审计。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险, 投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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
过去三个月	3.53%	0.63%	8.51%	0.55%	-4.98%	0.08%
2014年度上半年	-2.05%	0.68%	-2.70%	0.63%	0.65%	0.05%
2013年度	-15.77%	1.24%	-3.46%	0.84%	-12.31%	0.40%
2012年度	14.46%	1.35%	6.63%	0.77%	7.83%	0.58%
2011年度	-27.15%	1.02%	-14.18%	0.79%	-12.97%	0.23%
2010年度 (2010年 6月30日 —2010年 12月31日)	12.60%	1.07%	11.97%	0.94%	0.63%	0.13%

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

交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010 年 6 月 30 日至 2014 年 9 月 30 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、基金财产划拨支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

本基金基金合同终止基金财产清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产

总值中扣除。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用

(1) 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。

管理费的计算方法如下：

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

H 为每日计提的基金管理费

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 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，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 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，支付日期顺延。

(3) 除管理费和托管费之外的基金费用由基金托管人根据其他有关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

本基金的申购费用由基金申购人承担，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。场外申购可以采取前端收费模式和后端收费模式，场内申购目前只支持前端收费模式。

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。

本基金的申购费率如下：

	申购金额（含申购费）	前端申购费率
申购费率（前端）	50 万元以下	1.5%
	50 万元（含）至 100 万元	1.2%
	100 万元（含）至 200 万元	0.8%
	200 万元（含）至 500 万元	0.5%
	500 万元以上（含 500 万）	每笔交易 1000 元

	持有期限	后端申购费率
申购费率（后端）	1 年以内（含）	1.8%
	1 年—3 年（含）	1.2%
	3 年—5 年（含）	0.6%
	5 年以上	0

因红利自动再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。

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前端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。

通过本公司直销柜台申购本基金前端基金份额的养老金客户特定申购费率如下表：

特定申购费率	申购金额（含申购费）	前端特定申购费率
--------	------------	----------

(前端)	50 万元以下	0.60%
	50 万元 (含) 至 100 万元	0.48%
	100 万元 (含) 至 200 万元	0.32%
	200 万元 (含) 至 500 万元	0.20%
	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

场外申购可以采取前端收费模式和后端收费模式, 场内申购目前只支持前端收费模式。

前端收费模式:

申购总金额=申请总金额

净申购金额=申购总金额/ (1+申购费率)

申购费用=申购总金额-净申购金额

申购份额= (申购总金额-申购费用) / T 日基金份额净值

场内申购金额的有效份额保留到整数位, 剩余部分对应申购资金返回投资人。

对应返还申购金额=净申购金额-取整数位后确认的申购份额×T 日基金份额净值

例一: 某投资人投资 40,000 元申购本基金 (非网上交易), 假设申购当日基金份额净值为 1.040 元, 如果其选择前端收费方式, 申购费率为 1.5%, 则其可得到的申购份额为:

申购总金额=40,000 元

净申购金额=40,000/ (1+1.5%) =39,408.87 元

申购费用=40,000-39,408.87=591.13 元

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

如果投资人是场内申购, 申购份额为 37,893 份, 则:

对应返还申购金额=39,408.87-37,893×1.040=0.15 元

即其余 0.14 份对应金额 0.15 元返回给投资人。如果投资人是场外申购，申购份额为 37,893.14 份。

后端收费模式：

申购总金额=申请总金额

申购份额=申购总金额/T 日基金份额净值

当投资人提出赎回时，后端认购费用的计算方法为：

后端申购费用=赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率

例二：某投资人投资 40,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.040 元，如果其选择后端收费方式，则其可得到的申购份额为：

申购份额 = 40,000 / 1.040 = 38,461.54 份

即：投资人投资 40,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.040 元，则可得到 38,461.54 份基金份额，但其在赎回时需根据其持有时间按对应的后端申购费率交纳后端申购费用。

(3) 赎回费用

赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用的 25% 归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本基金的赎回费率如下：

	持有期限	赎回费率
赎回费率	1 年以内 (含)	0.5%
	1 年—2 年 (含)	0.2%
	2 年以上	0

基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整申购费率和赎回费率，最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率开始实施 3 个工作日前在指定媒体上公告。

(4) 赎回金额的计算

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

如果投资人在认(申)购时选择交纳前端认(申)购费用,则赎回金额的计算方法如下:

$$\text{赎回费用} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值} - \text{赎回费用}$$

例一:某投资人赎回通过前端认购(申购)持有的 10,000 份基金份额,对应的赎回费率为 0.5%,假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元,则其可得到的赎回金额为:

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.016 \times 0.5\% = 50.80 \text{ 元}$$

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

即:投资人赎回本基金 10,000 份基金份额,假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元,则其可得到的赎回金额为 10,109.20 元。

如果投资人在认(申)购时选择交纳后端认(申)购费用,则赎回金额的计算方法如下:

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

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

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{后端认(申)购费用} - \text{赎回费用}$$

例二:某投资人赎回通过后端认购持有的 10,000 份基金份额,对应的后端认购费率为 1.6%,赎回费率为 0.5%,假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元,则其可得到的赎回金额为:

$$\text{后端认购费用} = 10,000 \times 1.00 \times 1.6\% = 160.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.016 \times 0.5\% = 50.80 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.016 - 160.00 - 50.80 = 9,949.20 \text{ 元}$$

即:投资人赎回通过后端认购所得本基金 10,000 份基金份额,对应的赎回费率为 0.5%,假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元,投资人对应的后端认购费率是 1.6%,认购时的基金份额初始面值为 1.00 元,则其可得到的赎回金额为 9,949.20 元。

例三：某投资人赎回通过后端申购持有的 10,000 份基金份额，对应的后端申购费率是 1.8%，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，申购时的基金份额净值为 1.010 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.016=10,160 元

后端申购费用=10,000×1.010×1.8%=181.80 元

赎回费用=10,160×0.5%=50.80 元

赎回金额=10,160-181.80-50.80=9,927.40 元

即：投资人赎回本基金 10,000 份基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，投资人对应的后端申购费率是 1.8%，申购时的基金净值为 1.010 元，则其可得到的赎回金额为 9,927.40 元。

(5) 转换费

1) 每笔基金转换视为一笔赎回和一笔申购，基金转换费用相应由转出基金的赎回费用及转出、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。

(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:

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

$$\text{转出基金的赎回费} = 0 \text{ 元}$$

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

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

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

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

转出确认金额 = $100,000 \times 1.00 = 100,000$ 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 = $100,000 \times 0.8\% / (1 + 0.8\%) = 793.65$ 元

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

2) 后端收费模式下基金转换份额的计算公式及举例

转出确认金额 = 转出的基金份额 \times 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 \times 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 \times 对应的转出与转入基金的申购补差费率

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

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：

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

转出基金的赎回费=125,000×0.2%=250 元

转入确认金额=125,000-250=124,750 元

转出与转入基金的申购补差费=124,750×0=0 元

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

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

转出确认金额=100,000×1.250=125,000 元

转出基金的赎回费=125,000×0.2%=250 元

转入确认金额=125,000-250=124,750 元

转出与转入基金的申购补差费=124,750×1.2%=1497 元

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

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

转出确认金额=100,000×0.850=85,000 元

转出基金的赎回费=85,000×0=0 元

转入确认金额=85,000-0=85,000 元

转出与转入基金的申购补差费=85,000×0.2%=170 元

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

例八：某投资者持有交银货币 A 级基金份额 100,000 份，该 100,000 份基金份额未结转的待支付收益为 61.52 元，转换申请当日交银增利 B 类基金份额净值为 1.2700 元，交银货币的基金份额净值为 1.00 元。若该投资者将 100,000 份交银货币 A 级基金份额转换为交银增利 B 类基金份额，则转入确认的交银增利 B 类基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.00=100,000 元

转出基金的赎回费=0 元

转入确认金额=100,000-0=100,000 元

转出与转入基金的申购补差费=100,000×0=0 元

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

(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”)办理开户和本基金前端基金份额的申购、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后端基金份额的认/申购业务,通过转托管转入网上直销账户的后端收费模式的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前端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前端基金份额的单笔最低金额为 1000 元(含),单笔定期定额投资最低金额为 100 元(含),不受网上直销日常申购的最低金额限制;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) 基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整申购费率和赎回费率,最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更,基金管理人最迟应于新的费率开始实施 3 个工作日前在指定媒体上公告。

(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。

基金合同生效前所发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用, 不得从基金财产中列支。

(四) 基金管理费和托管费的调整

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和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率, 无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

(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“九、基金的转换”中相关内容。

(六) 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 2014 年 9 月 30 日。

(七) 更新了“十一、基金的业绩”中相关内容, 数据截止到 2014 年 9 月 30 日。

(八) 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

二〇一五年二月十三日