

交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德 中证环境治理指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第 二次提示性公告

交银施罗德基金管理有限公司已于 2016 年 5 月 30 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及交银施罗德基金管理有限公司网站

(www.fund001.com, www.bocomschroder.com) 发布了《交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于 2016 年 5 月 31 日发布了第一次提示性公告。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作管理办法》”）和《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，本基金的基金份额包括交银环境治理份额，基金代码 164908，场内简称“环境治理”；交银环境治理 A 份额，基金代码 150319，场内简称“环境 A”；交银环境治理 B 份额，基金代码 150320，场内简称“环境 B”）的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯方式召集本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型方案及基金合同修改等相关事宜，将本基金转型为“交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）”，并对《基金合同》进行修订。会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：自 2016 年 6 月 7 日起至 2016 年 6 月 29 日 17:00 止（以基金管理人收到表决票的时间为准）

3、会议纸质表决票的寄达地点：

收件人：交银施罗德基金管理有限公司

地址：上海浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 22 楼

邮政编码：200120

联系人：余川

联系电话：021-61055050

通过专人送交、邮寄送达的，请在信封背面注明系用于本基金基金份额持有人大会表决之用（如“交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”）。

二、会议审议事项

本次会议审议事项为《关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明见《关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》（见附件四）。

三、权益登记日

本次会议的权益登记日为2016年6月6日，即该日在本基金注册登记机构登记在册的交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金全体基金份额持有人（含交银环境治理份额、交银环境治理A份额和交银环境治理B份额的基金份额持有人）或其授权的代理人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、表决票的填写和寄交方式

本次持有人大会的表决方式仅限于书面纸质表决。

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站（www.fund001.com，www.bocomschroder.com）下载并打印等方式填制表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）基金份额持有人可根据本公告第五章的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人纸面方式授权代理

投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告“第五章第（三）条授权方式”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2016年6月7日起至2016年6月29日17:00以前（以表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址下述收件人：

收件人：交银施罗德基金管理有限公司

地址：上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期22楼

邮政编码：200120

联系人：余川

联系电话：021-61055050

通过专人送交、邮寄送达的，请在信封背面注明系用于本基金基金份额持有人大会表决之用（如“交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”）。

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次会议，使基金份额持有人在本次会议上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

（一）委托人

本基金的基金份额持有人可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以注册登记机构的登记为准。

（二）受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面的授权方式授权受托人代为行使表决权。授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站（www.fund001.com，www.bocomschroder.com）下载并打印等方式获取授权委托书样本。

1、基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件：

(1) 个人基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥并签署授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

(2) 机构基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本）并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构持有人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本）并在授权委托书上加盖该机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

2、授权效力确定规则

(1) 如果同一基金份额存在多次以有效纸面方式授权的，以时间在最后的一次纸面授权为准。同时多次以有效纸面方式授权的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为无效授权；

(2) 如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为无效授权；

(3) 如委托人既进行委托授权，自身又送达了有效表决票，则以自身有效表决票为准。

六、会议召开的条件和表决票数要求

本次会议召开的条件为：本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的交银环境治理份额、交银环境治理 A 份额和交银环境治理 B 份额不小于在权益登记日各自份额类别基金总份额的二分之一（含二分之一）；

本会议表决的票数要求为：基金份额持有人持有的每一基金份额在各自份额类别内拥有同等的投票权。本次议案按特殊决议处理，《关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》须经参加大会的交银环境治理份额、交银环境治理 A 份额和交银环境治理 B 份额基金份额持有人或其代理人在各自份额类别内所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，基金管理人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

七、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中信银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日后的 2 个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、表决票效力的认定如下：

（1）纸面表决票通过专人送交或邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以收到时间为准。2016 年 6 月 29 日 17:00 以后送达基金管理人的，为无效表决。

（2）纸面表决票的效力认定：

1) 纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达基金管理人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

2) 如表决票上的表决意见未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

3) 如表决票上签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送

达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

4) 基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

A. 送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

B. 送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

C. 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要参加大会的交银环境治理份额持有人、交银环境治理 A 份额持有人、交银环境治理 B 份额持有人或其各自代理人所代表的基金份额不小于在权益登记日各自份额类别基金总份额的二分之一（含二分之一），方可召开。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据 2013 年 6 月 1 日生效的《基金法》，基金管理人可在规定时间内（即本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内）就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表交银环境治理份额、交银环境治理 A 份额和交银环境治理 B 份额各自份额类别基金总份额三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见，重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知（如有）。

九、本次持有人大会相关机构

1、召集人：交银施罗德基金管理有限公司

联系地址：上海浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-22 楼

联系人：余川

联系电话：（021）61055050

客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），（021）61055000

网址：www.fund001.com，www.bocomschroder.com

2、基金托管人、监督人：中信银行股份有限公司

联系地址：北京市东城区朝阳门北大街9号东方文化大厦北楼

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

3、公证机关：上海市东方公证处

联系地址：上海市凤阳路660号

联系人：林奇

联系电话：（021）62154848

邮政编码：200041

4、见证律师事务所：通力律师事务所

联系电话：（021）31358666

十、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站

（www.fund001.com，www.bocomschroder.com）查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-700-5000（免长途话费），（021）

61055000咨询。

3、本次基金份额持有人召开期间，投资人可以按照本基金招募说明书的相关规定正常办理申购、赎回、转托管及场内份额配对转换业务，业务受理不受影响。相关业务受理若有变化，详见基金管理人发布的相关公告。

4、如本次基金份额持有人大会不能成功召开或者未能通过本次会议审议的议案，根据《基金法》和《基金合同》的有关规定，本基金可能会重新召开基金份额持有人大会。

5、本公告的有关内容由交银施罗德基金管理有限公司负责解释。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一六年六月一日

附件一：《关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》

附件二：《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》

附件一：

关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案

交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金份额持有人：

为保护基金份额持有人的利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型及《基金合同》修改事宜，将本基金转型为“交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）”，并对《基金合同》进行修订。基于此次本基金由分级基金转为上市开放式基金（LOF）事宜，按照现时有效的相关法律法规和中国证监会的有关规定对《基金合同》进行修订，修订内容包括删去基金份额的分级与净值计算规则、场内份额配对转换、份额折算等基金份额分级相关条款，变更基金名称、基金的存续条件、基金份额持有人大会、基金估值、基金的收益与分配、基金合同终止事由以及其他部分条款。修改的具体内容详见附件四《关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》。

本次基金转型及《基金合同》修改如获得基金份额持有人大会审议批准，为实施本基金的转型，提议授权基金管理人办理本次基金转型及《基金合同》修改的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在实施转型前披露修改后的基金法律文件；提议授权基金管理人在转型实施前，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回安排等事项的转型实施安排规则并提前公告。

以上议案，请予审议。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一六年五月三十日

附件二：

交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票
基金份额持有人姓名或名称：

证件号码（身份证件号/营业执照号）：

审议事项 同意 反对 弃权

《关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》

基金份额持有人/受托人签名或盖章

年 月 日

说明：

1. 本表决票中“证件号码”，仅指基金份额持有人持有本基金基金份额的基金账号当前所使用的证件号码，基金份额持有人若因证件号码发生过更新或其他原因不确定其基金账号当前所使用的证件号码，可拨打本基金管理人客户服务电话400-700-5000（免长途话费），（021）61055000 查询。
2. 请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内划“√”，同一议案只能表示一项意见。
3. 基金份额持有人开立持有本基金的基金账户为多个的，若无注明，以上表决意见视为持有人或其受托人就持有人全部基金账户所持有的本基金全部份额作出的表决意见。
4. 表决票未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票或未投的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持份额数的表决结果均计为“弃权”。
5. 本表决票可通过剪报、复印，或登陆基金管理人网站（www.fund001.com，www.bocomschroder.com）下载并打印等方式获取。

附件三：

授权委托书

本人（或本机构）持有交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额，就交银施罗德基金管理有限公司官网

(www.fund001.com, www.bocomschroder.com) 及《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》于 2016 年 5 月 30 日公布的《交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》所述需基金份额持有人大会审议的事项，本人（或本机构）的意见为（请在意见栏下方划“√”）：

同意 反对 弃权

本人（或本机构）特此授权 代表本人（或本机构）参加审议上述事项的基金份额持有人大会，并按照上述意见行使表决权。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，以最多两次重新召开持有人大会为限，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码（填写）：

受托人（签字/盖章）：

受托人证件号码（填写）：

签署日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项：

1. 基金份额持有人可以委托符合法律和本公告规定的机构和个人，代为行使本

次基金份额持有人大会上的表决权。

2. 基金份额持有人开立持有本基金的基金账户为多个的，若仅以其中部分账户所持有的本基金基金份额授权受托人参会和投票的，应当注明该账户号码。若不注明的，视为授权受托人就其全部账户所持有的本基金份额参会和进行投票。如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为无效授权。

3. 本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，仅指基金份额持有人持有本基金基金份额的基金账号当前所使用的证件号码，基金份额持有人若因证件号码发生过更新或其他原因不确定其基金账号当前所使用的证件号码，可拨打本基金管理人客户服务电话 400-700-5000（免长途话费），（021）61055000 查询。

4. 具体的授权效力确定规则请参见《交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》正文。

5. 如本次持有人大会权益登记日，投资者未在本基金注册登记机构登记在册，则其授权无效。

6. 授权委托书可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站下载

（www.fund001.com，www.bocomschroder.com）并打印等方式获取，在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：

关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明

一、重要提示

交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金（以下简称“交银施罗德环境治理指数基金”或“本基金”）于 2015 年 8 月 13 日成立并正式运作。为保护基金份额持有人的利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型及基金合同修改事宜，将本基金转型为“交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）”，并对基金合同

进行修订。

本次交银施罗德环境治理指数基金转型方案及基金合同修改须经参加大会的交银环境治理份额持有人、交银环境治理 A 份额持有人、交银环境治理 B 份额持有人或其各自代理人在各自份额类别内所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，故本转型方案存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，基金管理人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。中国证监会对本次转型方案的备案，不代表其对本次转型方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、基金转型方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金”变更为“交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）”。

（二）变更《基金合同》名称

将《基金合同》的名称由“《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》”变更为“《交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金合同》”。

（三）不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制

交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）拟由交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型而来，转型后由指数分级基金转为上市开放式基金（LOF），因而不设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制，删去相关内容，包括基金份额的分级与净值计算规则、场内份额的配对转换、基金份额折算等章节以及其他相关条款。

（四）基金份额的转换

本基金管理人将在基金份额持有人大会决议生效后，在新修改的基金合同生效前对交银环境治理份额、交银环境治理 A 份额、交银环境治理 B 份额进行份额的转换。交银环境治理份额的场外份额将转换为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）场外份额，交银环境治理份额的场内份额、交银环境治理 A 份额、交银环境治理 B 份额将转换为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）的场内份额。转换完成后，基金份额持有人持有的基金份额数将按照转换规则相应增加或减少。

基金份额转换的具体安排详见基金管理人届时发布的公告。

（五）增加《基金合同》“第四部分 基金的历史沿革”

拟增加为：

交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）由交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型而来。

交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金经 2015 年 5 月 20 日中国证监会证监许可【2015】940 号文准予募集注册，基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。经中国证监会书面确认，《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 13 日生效。

交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于 XX 年 XX 月 XX 日表决通过了《关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，同意交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金由指数分级基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称相应变更为“交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）”，交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金之交银环境治理份额、交银环境治理 A 份额及交银环境治理 B 份额均转换为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）份额。转型后，基金的投资目标、投资范围不变。

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，定于 XX 年 XX 月 XX 日正式实施基金转型，自基金转型实施日起，《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》失效且《交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金合同》同时生效，交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金正式变更为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）。

（六）删除《基金合同》“第五部分 基金份额的发售”、“第六部分 基金备案”中的“一、基金备案的条件”、“二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式”。

（七）修改基金存续条件相关内容

原有表述：

《基金合同》“第六部分 基金备案”中的“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提前终止基金合同，不需召开基金份额持有人大会。

法律法规另有规定时，从其规定。

拟修改为：

《基金合同》“第五部分 基金的存续”

基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

（八）修改基金份额的申购与赎回相关内容

暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

删除以下表述：

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金销售支付结算机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

（九）修改基金份额持有人大会相关内容

原有表述：

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

拟修改为：

2、在符合法律法规及本基金合同规定、并且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

并删除以下表述：

（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用；

（十）修改基金投资相关内容

1、风险收益特征

原有表述：

本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额，其中交银环境治理份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银环境治理 A 份额具有低预期风险、

预期收益相对稳定的特征；交银环境治理 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。

拟修改为：

本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。

2、投资策略

拟增加以下内容：

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。

3、投资限制的组限制

原有表述：

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

拟修改为：

基金管理人应当自基金转型实施日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

4、业绩比较基准

原有表述：

……若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。标的指数发生变更的，本基金业绩比较基准也相应变更。

拟修改为：

……若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。标的指数发生变更的，本基金业绩比较基准也相应变更。

（十一）修改基金资产的估值

1、估值对象

原有表述：

基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

拟修改为：

基金所拥有的股票、债券、衍生工具和其它投资等持续以公允价值计量的金融资产及负债。

2、估值方法

原有表述：

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按法律法规以及监管部门最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

拟修改为：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

(2) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(3) 当投资品种不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

(4) 如有充足理由认为按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

(5) 存在相关法律法规以及监管部门有相关规范的，从其规定。如有新增事项，

按监管部门最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

3、鉴于转型后不再进行基金份额分级，基金资产的估值程序、基金份额净值估值错误处理的方法、基金净值的确认也需进行相应修改

转型后的估值程序拟修改为：

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

转型后的基金份额净值估值错误处理的方法拟修改为：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

转型后的基金净值的确认拟修改为：

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对基金净值予以公布。

（十二）修改基金的费用与税收

删除以下表述：

降低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。

（十三）修改基金的收益与分配

原有表述：

本基金（包括交银环境治理份额、交银环境治理 A 份额和交银环境治理 B 份额）存续期内不进行收益分配。

拟修改为：

一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

三、基金收益分配原则

- 1、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者

的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

（十四）修改基金的信息披露

拟增加以下内容：

（十一）基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

（十五）修改基金合同终止事由

原有表述：

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、本基金作为被合并方与其他基金进行合并的；
- 4、连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的；
- 5、《基金合同》约定的其他情形；
- 6、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

拟修改为：

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（十六）本次基金转型及基金合同修改如获得基金份额持有人大会审议批准，为了基金转型期间平稳运作，基金管理人提请基金份额持有人大会同意，在基金份额持有人大会决议生效日起至基金转型实施日止的期间，本基金的股票投资比例可不受《基金合同》约定的“本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，本基金投资于中证环境治理指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%”的比例限制。

（十七）其他修改内容

为使《基金合同》适应新的法律法规要求和业务需要，在根据上述转型方案的要点修改《基金合同》的同时，对《基金合同》其他部分条款一并进行了修改。

（十八）授权基金管理人办理本次基金转型和基金合同修改的有关具体事宜

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在实施转型前披露修改后的基金法律文件，同时基金管理人在转型实施前，将根据基金份额持有人大会的授权，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回安排等事项的转型实施安排规则并提前公告。《交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金合同》经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签章，自基金转型实施日起生效，《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

三、基金管理人对基金转型及基金合同修改相关情况的说明

（一）交银施罗德环境治理指数基金基本情况

交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金经 2015 年 5 月 20 日中国证监会证监许可【2015】940 号文准予募集，基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。经中国证监会书面确认，《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 13 日生效。

（二）基金转型法律方面的可行性

本基金由分级基金转型为上市开放式基金（LOF），删去基金份额的分级与净值计算规则、场内份额配对转换、份额折算等基金份额分级相关条款，变更基金名称、基金的存续条件、基金份额持有人大会、基金估值、基金的收益与分配、基金合同终止事由以及其他部分条款，属于《基金合同》的变更。本次对《基金合同》的修改事宜属于《基金合同》第十二部分基金份额持有人大会规定的“对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项”，根据《基金合同》第二十四部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，“变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。”且本次基金份额持有人大会决议按特殊决议处理，须经参加大会的交银环境治理份额持有人、交银环境治理 A 份额持有人、交银环境治理 B 份额持有人或其各自代理人在各自份额类别内所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可生效。因此，本次基金转型相应修改《基金合同》不存在法律方面的障碍。

（三）基金转型运作方面的可行性

为实现基金转型的平稳过渡，本基金管理人已就基金变更有关的会计处理、注册登记、系统准备方面进行了深入研究，经与基金托管人的沟通和协作，做好了基金转型的相关准备。本次基金转型不存在技术方面的障碍。

（四）基金管理人修订合同的可行性

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议以及法律法规的规定修订《基金合同》。

四、基金转型的主要风险及预备措施

（一）持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要参加大会的交银环境治理份额持有人、交银环境治理 A 份额持有人、交银环境治理 B 份额持有人或其各自代理人所代表的基金份额不小于在权益登记日各自份额类别基金总份额的二分之一（含二分之一）方可举行。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将通过各种渠道联系基金份额持有人，积极邀请基金份额持有人自行或委托他人进行投票。

如有必要，基金管理人将推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如在投票表决截止日后，因不符合上述条件本次基金份额持有人大会确实未能成功召开，那么根据 2013 年 6 月 1 日生效的《基金法》，基金管理人可在本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就该次大会议案二次召集基金份额持有人大会。

（二）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范《基金合同》的修订方案被持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对《基金合同》的修订方案进行适当的调整，并重新公告。基金管理人可以在必要的情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

本次基金份额持有人大会如确实未能通过本次会议审议的议案，根据《基金法》及《基金合同》的有关规定，本基金可能会再次召开基金份额持有人大会。

（三）基金转型后遭遇大规模赎回的流动性风险

为应对基金转型可能引发的大规模赎回，本基金将尽可能提前做好流动性安排，保持投资组合的流动性以应对可能的赎回，降低净值波动率。

在全部基金份额均被赎回的情形下，本基金将进入财产清算程序。

（四）预防及控制基金转型过程中的操作及市场风险

为维护基金份额持有人利益，对于基金转型过程中可能发生的较大规模的申购赎

回或市场风险对基金净值造成大幅波动，基金管理人将根据申购赎回情况及时对可能存在的市场投资风险进行有效评估，保持相对合理的仓位水平，科学有效地控制基金的市场风险。

五、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容任何意见和建议，请通过以下方式联系基金管理：

交银施罗德基金管理有限公司

客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），（021）61055000

网址：www.fund001.com，www.bocomschroder.com

特此说明。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一六年五月三十日