



交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金 (更新) 招募说明书摘要

(2020 年第 1 号)

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇二〇年四月

【重要提示】

交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）为根据《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期后转型而来。

交银施罗德荣祥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】151 号文核准募集，自 2013 年 3 月 25 日至 2013 年 4 月 19 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，《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 4 月 24 日正式生效。

交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金第二个保本周期于 2019 年 5 月 27 日到期。由于不符合保本基金存续条件，按照《交银施罗德荣祥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“交银施罗德稳固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祥保本混合型证券投资基金募集的核准以及其保本周期到期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：市场风险、管理风险、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；投资资产支持证券的特定风险；

投资科创板股票的特定风险；投资本基金的其他风险等等。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。

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、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主作出投资决策，自行承担投资风险。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。本基金单一投资者持有基金份额数不得超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动超过前述 50% 比例的除外。

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合同当事人之间权利、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》、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 2020 年 4 月 2 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 12 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：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 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：阮红

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）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

阮红女士，董事长，博士。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，交银施罗德基金管理有限公司总经理。

陈朝灯先生，副董事长，博士。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。

周曦女士，董事，硕士。现任交通银行总行个人金融业务部副总经理兼风险管理部（资产保全部）副总经理。历任交通银行湖南省分行风险管理部、资产保全部、法律合规部、个人金融业务部总经理，交通银行总行个人金融业务部总经理助理。

孙荣俊先生，董事，硕士。现任交通银行总行风险管理部（资产保全部）副总经理。历任交通银行总行风险管理部副高级经理、高级经理，交通银行广西区柳州分行副行长，交通银行内蒙古区分行行长助理。

谢卫先生，董事，总经理，博士，高级经济师，民盟中央委员、全国政协委员。现任交银施罗德基金管理有限公司总经理，兼任交银施罗德资产管理(香港)有限公司董事长。历任中央财经大学教师，中国社会科学院财贸所助理研究员，中国电力信托投资公司基金部副总经理，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，交银施罗德基金管理有限公司副总经理。

李定邦（Lieven Debruyne）先生，董事，硕士。现任施罗德集团全球业务总裁、亚太区行政总裁，担任集团管理委员会成员。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。

郝爱群女士，独立董事，学士。历任人民银行稽核司副处长、处长，合作司调研员，非银司副巡视员、副司长，银监会非银部副主任，银行监管一部副主任、巡视员，汇金公司派出董事。

张子学先生，独立董事，博士。现任中国政法大学民商经济法学院教授，兼任基金业协会自律监察委员会委员。历任证监会办公厅副处长、上市公司监管部处长、行政处罚委员会专职委员、副主任审理员，兼任证监会上市公司并购重组审核委员会委员、行政复议委员会委员。

黎建强先生，独立董事，博士，教育部长江学者讲座教授。现任香港大学工业工程系荣誉教授，亚洲风险及危机管理协会主席，兼任深交所上市的中联重科集团

独立非执行董事。历任香港城市大学管理科学讲座教授，湖南省政协委员并兼任湖南大学工商管理学院院长。

2、基金管理人监事会成员

王忆军先生，监事长，硕士。现任交银金融学院常务副院长，交通银行人力资源部副总经理、教育培训部总经理。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，交通银行战略投资部总经理。

章骏翔先生，监事，硕士，志奋领学者，美国特许金融分析师(CFA)持证人。现任施罗德投资管理(香港)有限公司亚洲投资风险主管。历任法国安盛投资管理(香港)有限公司亚洲风险经理，华宝兴业基金管理有限公司风险管理部总经理，渣打银行(香港)交易风险监控等职。

刘峥先生，监事，硕士。现任交银施罗德基金管理有限公司综合管理部副总经理。历任交通银行上海市分行管理培训生，交通银行总行战略投资部高级投资并购经理，交银施罗德基金管理有限公司总裁办公室高级综合管理经理。

黄伟峰先生，监事，硕士。现任机构理财部(上海)总经理兼产品开发部总经理。历任平安人寿保险公司上海分公司行政督导、营销管理经理，交银施罗德基金管理有限公司行政部总经理助理、西部营销中心总经理。

3、基金管理人高级管理人员

谢卫先生，总经理。简历同上。

夏华龙先生，副总经理、首席信息官，博士，高级经济师。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)。

印皓女士，副总经理，硕士，兼任交银施罗德资产管理有限公司董事长。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。

许珊燕女士，副总经理，硕士，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。

余川女士，督察长，硕士。历任华泰证券有限责任公司综合发展部高级经理、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、投资运营总监。

4、本基金基金经理

凌超先生，基金经理。华中科技大学数量经济学硕士、武汉科技大学信息与计算科学学士。14 年证券投资行业从业经验。2006 年至 2009 年任长江证券股份有限公司研究员、投资经理，2009 年至 2012 年任光大保德信基金有限管理公司研究员、基金助理、基金经理，2012 年至 2016 年任海富通基金管理有限公司投资顾问、基金经理，2016 年至 2017 年任天弘基金管理有限公司固定收益部副总经理、基金经理。2010 年 8 月 31 日至 2012 年 3 月 1 日任光大保德信货币市场基金基金经理，2013 年 12 月 19 日至 2016 年 1 月 12 日任海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2014 年 4 月 2 日至 2016 年 1 月 12 日任海富通纯债债券型证券投资基金基金经理，2014 年 12 月 1 日至 2016 年 1 月 12 日任海富通稳固收益债券型证券投资基金基金经理，2016 年 5 月 14 日至 2017 年 7 月 13 日任天弘弘利债券型证券投资基金基金经理，2016 年 5 月 14 日至 2017 年 7 月 13 日任天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 5 月 14 日至 2017 年 7 月 13 日任天弘债券型发起式证券投资基金基金经理。2017 年 7 月加入交银施罗德基金管理有限公司，现任固定收益（公募）投资副总监。自 2018 年 2 月 13 日起担任交银施罗德增强收益债券型证券投资基金、交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金、交银施罗德强化回报债券型证券投资基金、交银施罗德增利增强债券型证券投资基金基金经理至今，2019 年 2 月 28 日至 2019 年 5 月 30 日担任交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金经理，并于 2019 年 5 月 31 日起担任转型后的交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金经理至今，2019 年 7 月 20 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、交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德多策略回报灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德优选回报灵活配置混合型

证券投资基金、交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金、交银瑞鑫定期开放灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德裕祥纯债债券型证券投资基金、交银施罗德恒益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

于海颖女士，2017 年 6 月 10 日至 2019 年 3 月 15 日任本基金转型前交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金经理。

孙超先生，2015 年 11 月 7 日至 2017 年 6 月 21 日任本基金转型前交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金经理。

章妍女士，2016 年 6 月 20 日至 2017 年 3 月 30 日任本基金转型前交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金经理。

项廷锋先生，2013 年 4 月 24 日至 2015 年 10 月 6 日任本基金转型前交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金经理。

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转型前交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金经理职责。

5、投资决策委员会成员

委员： 谢卫（总经理）

王少成（权益投资总监、基金经理）

于海颖（固定收益（公募）投资总监、基金经理）

马俊（研究总监）

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 2020 年 4 月 2 日，期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的销售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告;
- 7、计算并公告基金净值信息, 确定基金份额申购、赎回价格;
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
- 9、召集基金份额持有人大会;
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
- 11、以基金管理人名义, 代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
- 12、有关法律法規和中国证监会规定的其他职责。

(四) 基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为, 并承诺建立健全内部控制制度, 采取有效措施, 防止违反《证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为, 并承诺建立健全内部风险控制制度, 采取有效措施, 防止下列行为的发生:

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
- (2) 不公平地对待管理的不同基金财产;
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
- (5) 依照法律法規有关规定, 由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同, 并承诺建立健全内部控制制度, 采取有效措施, 防止违反基金合同行为的发生;

4、基金管理人承诺加强人员管理, 强化职业操守, 督促和约束员工遵守国家有关法律法規及行业规范, 诚实信用、勤勉尽责;

5、基金管理人承诺不从事其他法規规定禁止从事的行为。

(五) 基金经理承诺

1、依照有关法律法規和基金合同的规定, 本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(六) 基金管理人的内部控制制度

1、风险管理的原则

(1) 全面性原则

公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

(2) 独立性原则

公司设立独立的风险管理部，风险管理部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行监督和检查。

(3) 相互制约原则

公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4) 定性和定量相结合原则

建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，风险管理部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

(1) 董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

(2) 监事会

是公司常设的监事机构，对股东会负责。监事会对公司财务、公司董事、总经理及其他高级管理人员进行监督。

(3) 合规审核及风险管理委员会

作为董事会下的专业委员会之一，对公司内部控制制度、监察稽核制度进行检查评估；审查公司财务，对公司内部管理制度、投资决策程序和运作流程进行合规性审议；对公司资产与基金资产的经营进行评估。

(4) 风险控制委员会

作为总经理下设的专业委员会之一，风险控制委员会负责拟定公司风险管理战略及政策，制定灾难复原计划及紧急情况处理制度，确保公司风险控制符合标准，就潜在风险与相关部门协调，审阅公司审计报告及监察情况。

(5) 督察长

独立行使督察权利；直接对董事会负责；就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

(6) 风险管理部

风险管理部负责制定公司风险管理政策和防范及控制措施，组织执行，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，汇总公司业务所有的风险信息，独立识别、评估各类风险，提出风险控制建议，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。

(7) 审计部

审计部负责按照公司要求，根据国家法律法规及行业规范，结合公司战略发展及管理目标，对公司内部控制体系的适当性及运行的效果和效率进行独立评价，协助促进公司风险管理、控制和治理过程的完善，实现合规经营目标。

(8) 法律合规部

法律合规部负责公司的法律、合规事务及协调实施信息披露事务，依法维护公司合法权益，评估并处理公司运营中发生的法律、合规及信息披露相关问题，及时向公司管理层及全体员工传达法规及监管要求。

(9) 业务部门

风险管理是每一个业务部门首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

3、风险管理和内部风险控制的措施

(1) 建立内控体系，完善内控制度

公司建立、健全了内控体系，通过高管人员关于内控的明确分工，确保各项业务活动有恰当的组织 and 授权，确保监察活动独立，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制

建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

(3) 建立、健全岗位责任制

建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

建立了风险评估机制，通过适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

(5) 建立有效的内部监控系统

建立了足够、有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

(6) 使用数量化的风险管理手段

采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。

(7) 提供足够的培训

制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

二、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISA3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步

提升, 在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出, 获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号; 2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号; 2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号; 2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖; 2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立, 目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部, 拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 310 名, 其中具有高级职称的专家 60 名, 服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强, 高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称, 精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2020 年 3 月 31 日, 中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 523 只。

(二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定, 守法经营、规范运作、严格监察, 确保业务的稳健运行, 保证基金财产的安全完整, 确保有关信息的真实、准确、完整、及时, 保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作, 对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处, 配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作, 独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

(三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1、直销机构

本基金直销机构为本公司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：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 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：阮红

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

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。

2、代销机构

(1) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(2) 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：彭纯

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

(3) 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

(4) 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

(5) 平安银行股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址: 深圳市深南东路 5047 号

法人代表: 谢永林

电话: 0755-22166574

传真: 0755-82080406

联系人: 赵杨

客服电话: 95511-3 或 95501

网址: bank.pingan.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.csrbank.com

(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：王耀球
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) 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>

(10) 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

(11) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址: 上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人: 贺青

联系电话: 021-38676666

传真: 021-38670666

联系人: 朱雅崑

服务热线: 95521 / 4008888666

网址: www.gtja.com

(12) 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: 95587

网址: www.csc108.com

(13) 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

(14) 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: 陈共炎

电话: 010-83574507

联系人: 辛国政

客户服务电话: 400-888-8888

网址: www.chinastock.com.cn

(15) 招商证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

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: 霍达

电话: (0755) 82943666

传真: (0755) 82943636

联系人: 黄婵君

客户服务电话: 400-8888-111/95565

网址: www.newone.com.cn

(16) 中信证券股份有限公司

住所: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座

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: 张佑君

电话: 010-60838888

客服电话: 95548

网址: www.cs.ecitic.com

(17) 国都证券股份有限公司

住所: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人: 王少华

客户服务电话: 400-818-8118

网址: www.guodu.com

(18) 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

(19) 中信证券 (山东) 有限责任公司

住所: 青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址: 青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人: 姜晓林

电话: 0531-89606166

传真: 0532-85022605

联系人: 焦刚

客户服务电话: 95548

网址: sd.citics.com

(20) 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

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(24) 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

(25) 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

(26) 长城国瑞证券有限公司

住所: 厦门市莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址: 厦门市莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

法定代表人: 王勇

电话: (0592) 5161642

传真: (0592) 5161640

联系人: 赵钦

客户服务电话: (0592) 5163588

网址: www.xmzq.cn

(27) 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

(28) 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

(29) 渤海证券股份有限公司

住所: 天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址: 天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人: 王春峰

电话: (022) 28451991

传真: (022) 28451892

联系人: 蔡霆

客户服务电话: 400-651-5988

网址: www.bhzq.com

(30) 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

(31) 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: 吴坚

电话: (023) 63786141

传真: (023) 63786212

联系人: 张煜

客户服务电话: 95355、400-809-6096

网址: www.swsc.com.cn

(32) 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

(33) 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

(34) 中国中金财富证券有限公司

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：高涛

电话：(0755) 88320851

联系人：胡芷境

客户服务电话：95532/400-600-8008

网址：www.ciccwm.com

(35) 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

(36) 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

(37) 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

(38) 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: 010-60833754

传真: 021-60819988

联系人: 刘宏莹

客服电话: 400-990-8826

网站: www.citicsf.com

(39) 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: 毕明建

电话: (010) 65051166

传真: (010) 85679203

联系人: 杨涵宇

网址: www.cicc.com.cn

(40) 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

(41) 蚂蚁(杭州)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：周熾旻

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

(42) 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

(43) 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：单丙焱

客户服务电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

(44) 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

(45) 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

(46) 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/>

(47) 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

(48) 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

(49) 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/>

(50) 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

(51) 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/>

(52) 上海大智慧基金销售有限公司

住所: 上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

办公地址: 上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

法定代表人: 申健

电话: 021-0219988-35374

传真: 021-20219923

联系人: 张蜓

客户服务电话: 021-20292031

网址: <https://www.wg.com.cn>

(53) 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

(54) 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

(55) 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

(56) 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: 上海市昆明路 518 号北美广场 A1002-A1003 室

法定代表人: 王翔

电话: (021) 35385521

传真: (021) 55085991

联系人: 蓝杰

客户服务电话: 400-820-5369

网址: www.jiyufund.com.cn

(57) 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

(58) 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

(59) 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/

(60) 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: 4000 178 000

网址: www.lingxianfund.com

(61) 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

(62) 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

(63) 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

(64) 奕丰基金销售有限公司

住所: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 (入住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道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人: TEO WEE HOWE

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

(65) 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

(66) 日发资产管理 (上海) 有限公司

住所：上海市陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行大厦 3301 室
办公地址：上海市陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行大厦 3301 室
法定代表人：周泉恭
电话：(021) 61600500
传真：(021) 61600602
联系人：蔡小威
客户服务电话：400-021-1010, (021) 61600500
网址：www.rffund.com

(67) 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

(68) 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一号环球财讯中心 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

(69) 北京肯特瑞基金销售有限公司
住所：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址: 北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部
A 座 15 层

法定代表人: 王苏宁

电话: 95118

传真: 010-89189566

联系人: 李丹

客服热线: 95118

网址: kenterui.jd.com

(70) 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

(71) 北京蛋卷基金销售有限公司

住所: 北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址: 北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人: 钟斐斐

电话: (010) 61840688

传真: (010) 84997571

联系人: 侯芳芳

客户服务电话: 400-1599-288

网址: 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: 张焱

客户服务电话: 400-9500-888

网址: www.jfzinv.com

(74) 格上富信投资顾问有限公司

住所: 北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人: 李悦章

电话: (010) 85594745

传真: (010) 65983333

联系人: 张林

客户服务电话: 400-066-8586

网址: www.igesafe.com

(75) 上海万得基金销售有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址: 上海市浦东新区福山路 33 号 9 楼

法定代表人: 王廷富

电话: 021-50712782

传真: 021-50710161

联系人: 徐亚丹

客户服务电话: 400-821-0203

网址: www.520fund.com.cn

(76) 天津万家财富资产管理有限公司

住所: 天津自贸区(中心商务区)迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址: 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人: 李修辞

电话: (010) 59013828

传真: (010) 59013707

联系人: 王芳芳

客户服务电话: 010-59013842

网址: <http://www.wanjiawealth.com/>

(77) 上海挖财金融信息服务有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人: 胡燕亮

电话: (021) 50810687

传真: (021) 58300279

联系人: 李娟

客户服务电话: (021) 50810673

网址: www.wacaijijin.com

(78) 嘉实财富管理有限公司

住所: 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

办公地址: 北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人: 赵学军

电话: (021) 38789658

传真: (021) 68880023

联系人: 王宫

客户服务电话: 400-021-8850

网址: www.harvestwm.cn

(79) 南京苏宁基金销售有限公司

住所: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人: 王锋

电话: 025-66996699

传真: 025-66996699

联系人: 冯鹏鹏

客户服务电话: 95177

网址: www.snjjjin.com

(80) 北京百度百盈基金销售有限公司

住所: 北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

办公地址: 北京市海淀区信息路甲 9 号奎科大厦

法定代表人: 张旭阳

电话: 010-61952703

传真: 010-61951007

联系人: 霍博华

客户服务电话: 95599-9

网址: www.baiyingfund.com

(81) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

住所: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融中心 38 层

法定代表人: 张冠宇

电话: (010) 85870662

传真: (010) 59200800

联系人: 刘美薇

客户服务电话: 400-819-9868

网址: www.tdyhfund.com

(82) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所: 上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址: 北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人: 毛淮平

电话: 010-88066632

传真: 010-63136184

联系人: 张静怡

客户服务电话: 400-817-5666

网址: www.amcfortune.com

(83) 江苏汇林保大基金销售有限公司

住所: 南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址: 江苏省南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室

法定代表人: 吴言林

电话: 025-66046166 转 837

传真: 025-56663409

联系人: 孙平

客户服务电话: 025-66046166

网址: www.huilinbd.com

(84) 玄元保险代理有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人: 马永谱

电话: (021) 50701053

传真: (021) 50701053

客户服务电话: 400-080-8208

网址: www.licaimofang.cn

(85) 阳光人寿保险股份有限公司

住所: 海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人: 李科

电话: (010) 85632771

传真: (010) 85632773

联系人: 王超

客户服务电话: 95510

网址: <http://fund.sinosig.com>

(86) 大连网金基金销售有限公司

住所: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人: 樊怀东

电话: (0411-39027810)

传真: (0411-39027835)

联系人: 于秀

客户服务电话: 4000-899-100

网址: <http://www.yibaijin.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, 并在管理人网站公示。

(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) 50938782
传真: (010) 50938907
联系人: 赵亦清

(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：交银施罗德稳固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

在追求本金安全、有效控制风险的基础上，力争实现基金资产的持续稳定增值。

七、基金的投资范围

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%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；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

本基金在逐期追求投资本金安全的风险控制目标下追求基金收益的稳定递增。自转型完成之日起, 本基金以 3 年为一个运作周期逐期运作, 每一运作周期期满后且后一运作周期起始日前, 安排不少于 5 个工作日的运作调整期, 除对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取不低于 1.5% 的赎回费以外, 投资者在运作调整期内办理本基金的申购和赎回业务时不收取申购、赎回费用。

本基金在每一运作周期的投资目标为力求期末基金份额净值加上该运作周期累计分红金额不低于该运作周期第 1 个工作日的基金份额净值。在每一运作周期中, 本基金通过适当的投资策略和运作机制, 优化基金组合的风险收益和流动性, 增强对组合流动性的保护, 力争实现设定的投资目标, 满足投资人获取持续稳定收益的需求。

本基金不设置担保人或保本义务人, 不承诺基金份额持有人在本基金运作周期期满时可以获得保本金额的保证。

(1) 资产配置策略

本基金基于恒定比例组合保险 (CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance) 原理对包括债券、货币市场工具在内的固定收益类资产和包括股票、权证在内的权益类资产进行配置, 动态调整固定收益类资产与权益类资产投资的比例, 通过对固定收益类资产的投资实现每一运作周期到期时投资本金的保护, 并通过对权益类资产的投资寻求每一运作周期内基金资产的稳定增值。本基金对固定收益类资产和权益类资产的资产配置具体可分为以下四步:

第一步, 确定本基金在某一运作周期的价值底线 (Floor)。根据本基金运作周期到期时投资组合的最低目标价值和合理的贴现率, 确定本基金当前应持有的固定收益类资产数额, 亦即价值底线。

第二步, 计算本基金的安全垫 (Cushion)。通过计算基金投资组合现时净值超越价值底线的数额, 得到安全垫。

第三步, 确定风险乘数 (Multiplier)。本基金通过对宏观经济和证券市场运行状况和趋势的判断, 并结合基金的风险收益情况, 确定安全垫的放大倍数——风险

乘数。

第四步，动态调整固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并结合市场实际运行态势制定权益类资产投资策略，进行投资组合管理，实现基金资产在本金安全基础上的稳健增值。

(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, 通过对债券收益率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:

① 信用债券研究

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

②信用债券投资

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. 信用债券信用等级的变化。

b. 不同信用等级的信用债券，以及同一信用等级不同标的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；研究标的的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

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标的股票的研究，在此基础上量化投资部利用可转换债券定价模型，充分考虑转债发行后目标转债标的股票股价波动率可能出现的变化，对目标转债的股性进行合理定价。

对于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，通过优选具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资，以谋求超额收益。

在个股选择方面，本基金综合运用交银施罗德的股票研究分析方法和数量化投

资分析工具精选个股构建股票投资组合。具体而言, 本基金的个股选择通过品质筛选、公司质量评价、多元化价值评估的步骤进行, 挑选出具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票。

(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, 充分考虑权证资产的收益性、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、基金的业绩比较基准

本基金的整体业绩比较基准采用: 三年期银行定期存款税后收益率。

三年期银行定期存款税后收益率指按照本基金每一运作周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率 (按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位, 单位为百分数) 计算的与该运作周期同期限的税后收益率。

该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。

如果今后法律法规发生变化, 或者市场变化导致本业绩比较基准不再适用, 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业绩比较基准, 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。

十一、基金的投资

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈

述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2020 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期为 2019 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日。本报告财务资料未经审计师审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,373,841.00	8.53
	其中: 股票	6,373,841.00	8.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	64,469,243.10	86.29
	其中: 债券	64,469,243.10	86.29
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,238,186.91	3.00
8	其他各项资产	1,631,153.68	2.18
9	合计	74,712,424.69	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

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,385,076.00	1.99
C	制造业	2,834,413.00	4.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,448,160.00	2.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	706,192.00	1.02
S	综合	-	-
	合计	6,373,841.00	9.17

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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

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	002230	科大讯飞	42,000	1,448,160.00	2.08
2	002050	三花智控	83,500	1,447,055.00	2.08
3	600019	宝钢股份	241,700	1,387,358.00	1.99
4	000603	盛达资源	92,400	1,385,076.00	1.99
5	300413	芒果超媒	20,200	706,192.00	1.02

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	占基金资产净 值比例 (%)
1	国家债券	1,424,480.00	2.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,597,900.44	71.32
	其中：政策性金融债	49,597,900.44	71.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债 (可交换债)	13,446,862.66	19.34

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	64,469,243.10	92.71

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	占基金资产净值比例 (%)
1	108602	国开 1704	356,268	35,833,435.44	51.53
2	018007	国开 1801	136,620	13,764,465.00	19.79
3	128035	大族转债	26,260	3,052,987.60	4.39
4	110059	浦发转债	19,430	2,122,533.20	3.05
5	113011	光大转债	15,610	1,945,942.60	2.80

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
1	存出保证金	17,725.03
2	应收证券清算款	385,488.26
3	应收股利	-
4	应收利息	1,225,592.35
5	应收申购款	2,348.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,631,153.68

(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	占基金资产净
----	------	------	------	--------

				值比例(%)
1	128035	大族转债	3,052,987.60	4.39
2	113011	光大转债	1,945,942.60	2.80
3	128065	雅化转债	1,440,182.40	2.07
4	113020	桐昆转债	729,014.00	1.05
5	113522	旭升转债	715,300.00	1.03
6	128019	久立转 2	714,849.20	1.03
7	123007	道氏转债	711,379.20	1.02
8	123025	精测转债	692,760.60	1.00
9	123009	星源转债	633,887.85	0.91
10	128059	视源转债	563,926.01	0.81

(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 2019 年 12 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) 交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金

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	2.30%	0.14%	0.70%	0.01%	1.60%	0.13%
2019 年度 (自基金转型日起至 2019 年 12 月 31 日)	3.44%	0.12%	1.64%	0.01%	1.80%	0.11%

注：交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金从 2019 年 5 月 31 日起正式转型为交银施罗德稳固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三年期银行定期存款税后收益率。

(2) 交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019 年 4 月 1 日至 2019 年 5 月 30 日	0.09%	0.01%	0.46%	0.01%	-0.37%	0.00%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 5 月 30 日	0.75%	0.03%	1.15%	0.01%	-0.40%	0.02%
2018 年 7 月 1 日至 2019 年 5 月 30 日	3.27%	0.05%	2.55%	0.01%	0.72%	0.04%

月 30 日						
2016 年 7 月 1 日至 2019 年 5 月 30 日	7.39%	0.06%	8.13%	0.01%	-0.74%	0.05%
自基金合同生效起至 2019 年 5 月 30 日	51.11%	0.47%	20.18%	0.01%	30.93%	0.46%

注：交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金从 2019 年 5 月 31 日起正式转型为交银施罗德稳固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

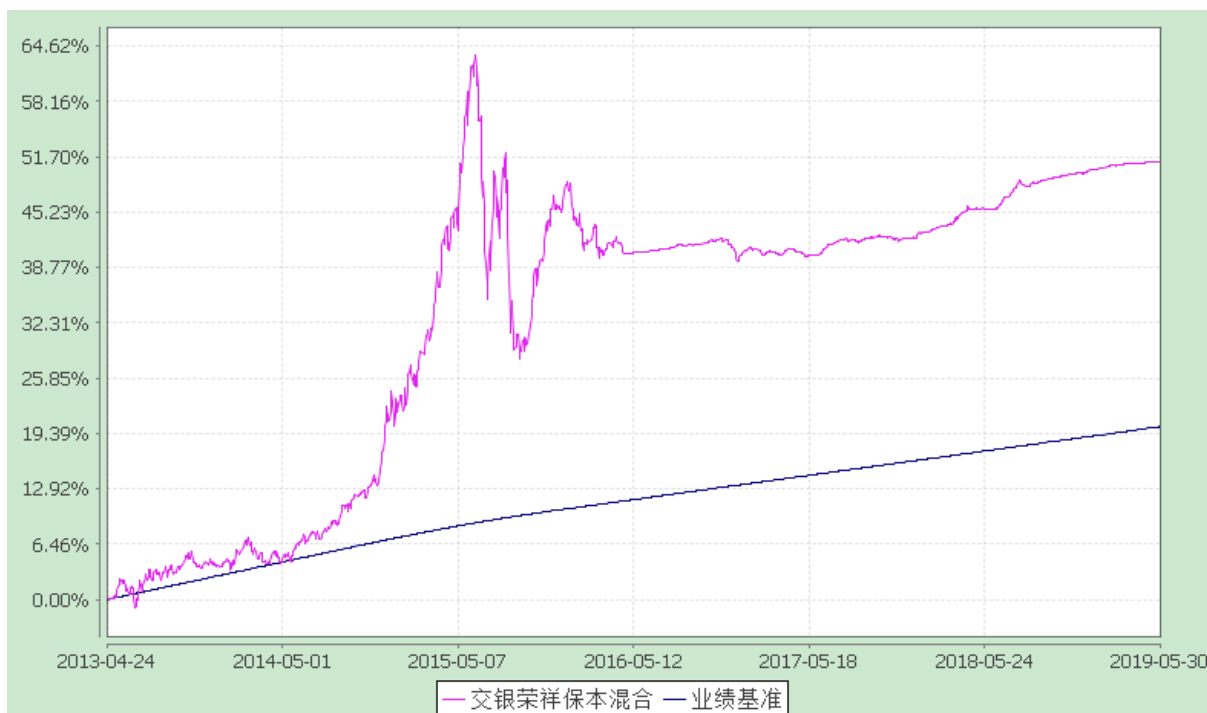
交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2019 年 5 月 31 日至 2019 年 12 月 31 日)



注：本基金由交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日为 2019 年 5 月 31 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祥保本混合型证券投资基金保本周期到期选择期截止日次日（即 2019 年 5 月 31 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

交银施罗德荣祥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 4 月 24 日至 2019 年 5 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：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，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前 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。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方

法如下:

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提, 逐日累计至每月月末, 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前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。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。

(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

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 万元)	每笔交易 1000 元

本基金对通过本公司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、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、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，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的养老金客户特定申购费率如下表：

	申购金额（含申购费）	特定申购费率
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 万元）	每笔交易 1000 元

投资者通过直销机构交易享有如下费率优惠，有关费率优惠活动的具体费率折扣及活动起止时间如有变化，敬请投资者留意本基金管理人的有关公告，届时费率优惠相关事项以最新公告为准：

1) 通过本基金管理人直销柜台办理本基金基金份额申购业务的投资者，享受申购费率一折优惠；对上述实施特定申购费率的养老金客户而言，以其目前适用的特定申购费率和上述一般申购费率的一折优惠中孰低者执行。若享有折扣前的原申购费率为固定费用的，则按原固定费率执行，不再享有费率折扣。

2) 通过本基金管理人网上直销交易平台办理本基金基金份额申购及定期定额投资业务的个人投资者享受申购费率及定期定额投资费率优惠，赎回费率标准不变。具体优惠费率请参见本基金管理人网站列示的网上直销交易平台申购费率表、定期定额投资费率表或相关公告。

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。

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。

(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，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，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

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

赎回费率如下：

赎回费率	持有期限	赎回费率
	7 日以内	1.5%
	7 日（含）—1 年（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：某投资者赎回 100,000 份基金份额，持有期限为半年，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：投资者在持有期限为半年时赎回 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) 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(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。

(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、《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金合同》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)《交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金合同》生效前的相关费用按当时有效的《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金合同》的约定支付。

(五) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十三、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、基金份额的申购与赎回”中相关内容。

(六) 更新了“九、基金的投资”中相关内容，数据截止到 2019 年 12 月 31 日。

(七) 更新了“十、基金的业绩”中相关内容，数据截止到 2019 年 12 月 31 日。

(八) 更新了“二十二、其他应披露事项”中相关内容。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇二〇年五月三十日