

**交银施罗德强化回报债券型证券投资基金**

**（更新）招募说明书摘要**

**（2014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：中信银行股份有限公司**

**二〇一四年七月**

基金招募说明书自基金合同生效日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日。

**【重要提示】**

交银施罗德强化回报债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2013年11月14日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”） 证监许可【2013】1443号文准予募集注册。本基金基金合同于2014年1月28日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险；由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险；交易对手违约风险；投资本基金特有的其他风险等等。本基金是一只债券型基金，其风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，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7月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年6月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

**一、基金管理人**

**（一）基金管理人概况**

名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）

办公地址：上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼

邮政编码：200120

法定代表人：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，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。

战龙先生，董事，总经理，CFA、CPA，硕士学历，兼任交银施罗德资产管理有限公司董事长。历任安达信（新加坡）有限公司审计师，澳洲信孚基金管理有限公司投资风险管理副总监，信安资产管理亚洲有限公司投资风险管理总监，荷兰国际投资管理亚太有限公司中国区总经理，招商基金管理有限公司常务副总经理，富达国际中国董事总经理。

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。

张科兵先生，监事，学士学历。现任交银施罗德基金管理有限公司研究总监。历任安达信（上海）企业咨询有限公司审计部高级审计师，普华永道会计师事务所审计部项目经理，第一证券有限责任公司投资部投资经理，申万巴黎基金管理有限公司（现申万菱信基金管理有限公司）投资管理部高级研究员，交银施罗德基金管理有限公司高级研究员、研究部副总经理、研究部总经理、基金经理。

3、高级管理人员

钱文挥先生，董事长，硕士学历。简历同上。

战龙先生，董事，总经理，硕士学历。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

赵凌琦女士，基金经理，财政部财政科研所经济学硕士，10年金融行业经验。曾任职于中国航空集团财务公司，中国人寿资产管理有限公司。2013年6月加入交银施罗德基金管理有限公司，现任固定收益部副总经理，2013年9月3日起担任交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金经理至今，2014年1月28日起担任本基金基金经理至今，2014年3月31日起担任交银施罗德理财60天债券型证券投资基金及交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理至今，2014年8月11日起担任交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金基金经理至今。

李德亮先生，基金经理，同济大学管理学学士，中国人民银行研究生部金融学硕士，8年证券从业经验。2006年4月加入交银施罗德基金管理有限公司，曾任行业分析师、基金经理助理，2013年9月4日起担任交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金经理至今， 2014年1月28日起担任交银施罗德强化回报债券型证券投资基金基金经理至今。

孙超先生，基金经理，中国人民大学学士，美国哥伦比亚大学硕士。3年证券从业经验。2011年7月至2013年6月曾任中信建投证券股份有限公司资产管理部经理、高级经理。2013年7月加入交银施罗德基金管理有限公司，曾任基金经理助理。2014年8月26日起担任交银施罗德理财60天债券型证券投资基金、交银施罗德双轮动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及本基金基金经理至今。

吕一楠先生，基金经理助理，澳洲新南威尔士大学统计学硕士和精算学硕士，4年金融行业从业经验。曾任大新保险服务有限公司（香港）投资分析师，中国人寿养老保险公司投资管理中心组合经理。2013年7月加入交银施罗德基金管理有限公司，2014年7月1日起担任交银施罗德理财60天债券型证券投资基金及本基金基金经理助理至今，2014年8月18日起担任交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金、交银施罗德双轮动债券型证券投资基金及交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金基金经理助理至今。

5、投资决策委员会成员

委员：项廷锋（投资总监、基金经理）

 战龙（总经理）

 管华雨（权益投资总监、基金经理）

 张科兵（研究总监）

上述人员之间不存在近亲属关系。

**二、基金托管人**

**（一）基金托管人情况**

1、基本情况

名称：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）

住所：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：常振明

成立时间：1987年4月7日

组织形式：股份有限公司

注册资本：467.873亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125号

联系人：中信银行资产托管部

联系电话： 010-65558812

传真：010-65550832

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

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

中信银行（601998.SH、0998.HK）成立于1987年，原名中信实业银行，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展，中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大，于2005年8月，正式更名“中信银行”。2006年12月，以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东，正式成立中信银行股份有限公司。同年，成功引进战略投资者，与欧洲领先的西班牙对外银行（BBVA）建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日，中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009年，中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司（简称：中信国金）70.32%股权。经过二十多年的发展，中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一，是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

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

2、主要人员情况

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

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

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

3、基金托管业务经营情况

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

截至2014年6月30日，中信银行已托管46只开放式证券投资基金及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，总托管规模逾3万亿元人民币。

**（二）基金托管人的内部控制制度**

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

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

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

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

**（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序**

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定，对基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

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

**三、相关服务机构**

**（一）基金份额销售机构**

1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人以及基金管理人的网上直销交易平台。

名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）

办公地址：上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼

法定代表人：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基金管理人网上直销交易平台办理开户、本基金的申购、赎回、定期定额投资、转换等业务，具体交易细则请参阅基金管理人网站。

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

2、场内代销机构

具有基金销售资格的上海证券交易所场内会员单位（具体名单见上海证券交易所网站）。

3、场外代销机构

（1） 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市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

（2） 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

电话：（010）66275654

传真：（010）66275654

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

（3） 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：牛锡明

电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（4） 招商银行股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：傅育宁

电话：（0755）83198888

传真：（0755）83195109

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（5） 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街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

（6） 杭州银行股份有限公司

住所：杭州市庆春路46号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

电话：（0571）85108309

传真：（0571）85151339

联系人：严峻

客户服务电话:（0571）96523，400-8888-508

网址：www.hzbank.com.cn

（7） 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

电话：（021）22169999

传真：（021）22169134

联系人：刘晨

客户服务电话： 10108998

网址：www.ebscn.com

（8） 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街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

（9） 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：顾伟国

电话：（010）66568430

联系人：田薇

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

（10） 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层

法定代表人：兰荣

电话：（021）38565785

传真：（021）38565955

联系人：谢高得

客户服务电话：400-8888-123

网址：www.xyzq.com.cn

（11） 中信证券股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：（010）60838888

传真：（010）60833739

联系人：陈忠

客户服务电话：95558

网址：www.cs.ecitic.com

（12） 申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

电话：（021）54033888

联系人：李清怡

客户服务电话：95523或4008895523

网址：www.sywg.com

（13） 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

（14） 中信证券（浙江）有限责任公司

住所：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层

办公地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层

法定代表人：沈强

电话：（0571）85776114

传真：（0571）85783771

联系人：李珊

客户服务电话：（0571）95548

网址：www.bigsun.com.cn

（15） 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507－1510室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：杨宝林

电话：（0532）85022326

传真：（0532）85022605

联系人：吴忠超

客户服务电话：（0532）96577

网址：www.zxwt.com.cn

（16） 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

（17） 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：（027）65799999

传真：（027）85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579或4008-888-999

网址：www.95579.com

（18） 齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李玮

电话：（0531）68889155

传真：（0531）68889752

联系人：吴阳

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（19） 江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

电话：（0451）85863696

传真：（0451）82287211

联系人：张背北

客户服务电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

（20） 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

（21） 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

（22） 瑞银证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：程宜荪

电话：（010）58328112

传真：（010）58328740

联系人：牟冲

客户服务电话：400-887-8827

网址：www.ubssecurities.com

（23） 长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

电话：（0755）83516289

传真：（0755）83516199

联系人：匡婷

客户服务电话：（0755）33680000，400-6666-888

网址：www.cc168.com.cn

（24） 国金证券股份有限公司

住所：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

（25） 渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：杜庆平

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

（26） 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人：高冠江

电话：（010）63081000

传真：（010）63080978

联系人：唐静

客户服务电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（27） 西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

电话：（023）63786141

传真：（023）63786212

联系人：张煜

客户服务电话：400-809-6096

网址：www.swsc.com.cn

（28） 华龙证券有限责任公司

住所：兰州市城关区东岗西路638号财富中心

办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富中心

法定代表人：李晓安

电话：（0931）4890208

传真：（0931）4890628

联系人：李昕田

客户服务电话：4006898888、（0931）4890208

网址：www.hlzqgs.com

（29） 中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：龙增来

电话：（0755）82023442

传真：（0755）82026539

联系人：刘毅

客户服务电话：400-600-8008

网址：www.china-invs.cn

（30） 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层

法定代表人：林义相

电话：（010）66045529

传真：（010）66045518

联系人：尹伶

客户服务电话：（010）66045678

网址：http://www.txsec.com，www.jjm.com.cn

（31） 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：周嬿旻

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

（32） 深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

电话：（0755）33227953

传真：（0755）82080798

联系人：汤素娅

客户服务电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn，www.jjmmw.com

（33） 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：单丙烨

客户服务电话：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

（34）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

（35）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/

（36）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

（37）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

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

**（二）登记机构**

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：（010）59378839

传真：（010）59378907

联系人：朱立元

**（三）出具法律意见书的律师事务所**

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

**（四）审计基金财产的会计师事务所**

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

首席合伙人：杨绍信

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：汪棣、沈兆杰

**四、基金的名称**

本基金名称：交银施罗德强化回报债券型证券投资基金

**五、基金的类型**

本基金类型：契约型开放式

**六、基金的投资目标**

本基金在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，重点投资于债券资产，力争实现基金资产的长期稳定增值。

**七、基金的投资方向**

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换债券及可分离转债、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类品种，和股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

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

**八、基金的投资策略**

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整债券、股票等大类资产比例。本基金以债券投资为核心，重点关注债券组合久期调整、期限结构配置及债券类属配置，并在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，同时本基金也通过综合运用骑乘操作、套利操作等策略精选个券，提高投资组合收益。此外，在风险可控的前提下，本基金适度关注股票、权证市场的运行状况与相应风险收益特征，有效把握投资机会，适时增强组合收益。

1、资产配置策略

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

2、债券投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，自上而下决定债券组合久期及债券类属配置；在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选个券。

（1）久期管理策略

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

（2）期限结构配置策略

本基金通过预期收益率曲线形态变化来调整投资组合的期限结构配置。根据债券收益率曲线形态、各期限段品种收益率变动、结合短期资金利率水平与变动趋势，分析预测收益率曲线的变化，测算子弹、哑铃或梯形等不同期限结构配置策略的风险收益，形成具体的期限结构配置策略。

（3）债券的类属配置策略

本基金定性和定量地分析不同类属债券类资产的信用风险、流动性风险、市场风险等因素及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力，通过比较并合理预期不同类属债券类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整不同类属债券类资产间的配置。

（4）杠杆放大策略

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

（5）信用债券投资策略

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

①信用债券研究

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

②信用债券筛选

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

a、信用债券信用评级的变化。

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

（6）资产支持证券（含资产收益计划）投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（7）可转换债券投资策略

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

3、股票投资策略

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

4、权证投资策略

本基金以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求当期稳定的基金资产收益。

**九、基金的业绩比较基准**

中债综合全价指数

中债综合全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，其指数样本涵盖国债、政策性银行债、商业银行债、地方企业债、中期票据以及证券公司短期融资券等各类券种，综合反映了债券市场整体价格和回报情况，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。该指数合理、透明、公开，具有较好的市场接受度，作为衡量本基金债券投资部分业绩的比较基准，较为合适。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数，则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后，调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

**十、基金的风险收益特征**

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

**十一、基金投资组合报告**

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

本基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月18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4月1日起至6月30日。本报告财务资料未经审计师审计。

1、报告期末基金资产组合情况

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
| 1 | 权益投资 | - | - |
|  | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 16,333,920.60 | 71.77 |
|  | 其中：债券 | 16,333,920.60 | 71.77 |
|  |  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 | 5,176,237.51 | 22.74 |
| 7 | 其他资产 | 1,249,383.35 | 5.49 |
| 8 | 合计 | 22,759,541.46 | 100.00 |

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（％） |
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 5,019,800.00 | 27.05 |
|  | 其中：政策性金融债 | 5,019,800.00 | 27.05 |
| 4 | 企业债券 | 6,328,700.00 | 34.10 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 1,801,620.00 | 9.71 |
| 7 | 可转债 | 3,183,800.60 | 17.15 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 16,333,920.60 | 88.01 |

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 | 140207 | 14国开07 | 30,000 | 3,010,800.00 | 16.22 |
| 2 | 140204 | 14国开04 | 20,000 | 2,009,000.00 | 10.82 |
| 3 | 124123 | 13南城投 | 20,000 | 2,004,000.00 | 10.80 |
| 4 | 1282499 | 12嘉定水MTN1 | 18,000 | 1,801,620.00 | 9.71 |
| 5 | 113003 | 重工转债 | 13,000 | 1,476,280.00 | 7.95 |

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 | 9,147.78 |
| 2 | 应收证券清算款 | 871,963.94 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 367,673.22 |
| 5 | 应收申购款 | 598.41 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,249,383.35 |

（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 | 113003 | 重工转债 | 1,476,280.00 | 7.95 |
| 2 | 113001 | 中行转债 | 712,530.00 | 3.84 |
| 3 | 113005 | 平安转债 | 569,350.60 | 3.07 |
| 4 | 110024 | 隧道转债 | 215,800.00 | 1.16 |
| 5 | 110020 | 南山转债 | 95,040.00 | 0.51 |

（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6月30日，所载财务数据未经审计师审计。

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

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

1. 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

（1）交银强化回报债券A/B：

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
| 过去三个月 | 1.69% | 0.07% | 2.42% | 0.09% | -0.73% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今（2014年1月28日至2014年6月30日） | 2.20% | 0.07% | 3.26% | 0.09% | -1.06% | -0.02% |

（2）交银强化回报债券C：

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
| 过去三个月 | 1.59% | 0.07% | 2.42% | 0.09% | -0.83% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今（2014年1月28日至2014年6月30日） | 2.20% | 0.07% | 3.26% | 0.09% | -1.06% | -0.02% |

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

交银施罗德强化回报债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2014年1月28日至2014年6月30日）

（1）交银强化回报债券A/B



注：本基金基金合同生效日为2014年1月28日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2014年6月30日，本基金尚处于建仓期。

（2）交银强化回报债券C



注：本基金基金合同生效日为2014年1月28日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2014年6月30日，本基金尚处于建仓期。

**十三、基金的费用与税收**

**（一）基金费用的种类**

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、基金的开户费用、账户维护费用；

9、本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

**（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式**

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.7%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起第3个工作日从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

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

H＝E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

（3）C类基金份额的销售服务费

本基金A类和B类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

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

C类基金份额的销售服务费将专门用于本基金的推广、销售与基金份额持有人服务。

2、与基金销售有关的费用

（1）申购费

本基金基金份额分为A类、B类和C类基金份额。投资人申购A类基金份额在申购时支付申购费用，申购B类基金份额在赎回时才支付相应的申购费用，申购C类基金份额不支付申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

A/B类基金份额的申购费用由A/B类基金份额申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

投资人可以多次申购本基金，申购费用按每笔申购申请单独计算。

本基金A类基金份额的申购费率如下：

|  |  |
| --- | --- |
| **申购金额（含申购费）** | **A类基金份额前端申购费率** |
| 50万元以下 | 0.8% |
| 50万元（含）至100万元 | 0.6% |
| 100万元（含）至200万元 | 0.5% |
| 200万元（含）至500万元 | 0.3% |
| 500万元以上（含500万） | 每笔交易1000元 |

本基金B类基金份额的申购费率如下：

|  |  |
| --- | --- |
| **持有期限** | **B类基金份额后端申购费率** |
| 1年以内（含） | 1.0% |
| 1年—3年（含） | 0.6% |
| 3年—5年（含） | 0.4% |
| 5年以上 | 0 |

上表中的“年”指的是365个自然日。

持有A/B类基金份额的投资人因红利自动再投资而产生的A/B类基金份额，不收取相应的申购费用。

本基金自2014年2月28日起，对通过基金管理人直销柜台申购A类基金份额的养老金客户实施特定申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。

通过基金管理人直销柜台申购本基金A类基金份额的养老金客户特定申购费率如下表：

|  |  |
| --- | --- |
| **申购金额（含申购费）** | **A类基金份额前端特定申购费率** |
| 50万元以下 | 0.32% |
| 50万元（含）至100万元 | 0.18% |
| 100万元（含）至200万元 | 0.10% |
| 200万元（含）至500万元 | 0.06% |
| 500万元以上（含500万） | 每笔交易1000元 |

有关养老金客户实施特定申购费率的具体规定以及活动时间如有变化，敬请投资人留意本公司发布的相关公告。

（2）申购份额的计算

（a）A类基金份额的申购

申购总金额=申请总金额

净申购金额=申购总金额/（1+申购费率）

（注：对于适用固定金额申购费用的申购，净申购金额＝申购总金额－固定申购费用金额）

申购费用=申购总金额-净申购金额

（注：对于适用固定金额申购费用的申购，申购费用＝固定申购费用金额）

申购份额=

场内申购的有效份额保留到整数位，剩余部分对应申购资金返还投资者。

例一：某投资者（非养老金客户）投资100,000元申购本基金的A类基金份额（非网上交易），假设申购当日A/B类基金份额净值为1.040元，申购费率为0.8%，如果该投资者是场外申购，则其可得到的申购份额为：

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

如果该投资者是场内申购，则其可得到的申购份额为95,390份，其余0.72份对应金额返回给投资者。

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

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：该养老金客户资100,000元通过基金管理人的直销柜台申购本基金的A类基金份额，假设申购当日A/B类基金份额净值为1.040元，则其可得到95,847.13份A类基金份额。

（b）B类基金份额的申购

申购总金额=申请总金额

申购份额＝

当投资者提出赎回时，后端申购费用的计算方法为：

后端申购费用＝赎回份额×T日A/B类基金份额净值×后端申购费率

例三：某投资者投资100,000元申购本基金的B类基金份额，假设申购当日A/B类基金份额净值为1.040元，则其可得到的申购份额为：

申购份额＝100,000/1.040＝96,153.85份

即：投资者投资100,000元申购本基金的B类基金份额，假设申购当日A/B类基金份额净值为1.040元，则可得到96,153.85份基金份额，但其在赎回时需根据其持有时间按对应的后端申购费率交纳后端申购费用。

（c）C类基金份额的申购

如果投资者选择申购C类基金份额，则申购份额的计算方法如下：

申购总金额=申请总金额

申购份额=申购总金额/T日C类基金份额净值

例四：某投资者投资100,000元申购本基金的C类基金份额，假设申购当日C类基金份额净值为1.040元，则其可得到的申购份额为：

申购份额＝100,000/1.040＝96,153.85份

即：投资者投资100,000元申购本基金的C类基金份额，假设申购当日C类基金份额净值为1.040元，则其可得到96,153.85份C类基金份额。

（3）赎回费

投资者赎回A类和B类基金份额收取赎回费用，该费用随基金份额的持有时间递减，赎回C类基金份额不收取赎回费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。本基金A类、B类基金份额的赎回费用由A类、B类基金份额赎回人承担，赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金A/B类基金份额的赎回费率如下：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 赎回费率 | **持有期限** | **赎回费率** |
| 1年以内（含） | 0.1% |
| 1年—2年（含） | 0.05% |
| 2年以上 | 0 |

上表中的“年”指的是365个自然日。

（4）赎回金额的计算

（a）A类基金份额的赎回

如果投资者赎回A类基金份额，则赎回金额的计算方法如下：

赎回费用=赎回份额×T日A/B类基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T日A/B类基金份额净值-赎回费用

例五：某投资者赎回100,000份A类基金份额，对应的赎回费率为0.1%，假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.016元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用=100,000×1.016×0.1%＝101.60元

赎回金额=100,000×1.016-101.60＝101,498.40元

即：投资者赎回100,000份A类基金份额，假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.016元，则其可得到的赎回金额为101,498.40元。

（b）B类基金份额的赎回

如果投资者赎回B类基金份额，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总额＝赎回份额×T日A/B类基金份额净值

后端（认）申购费用＝赎回份额×（认）申购日基金份额净值×后端（认）申购费率

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额＝赎回总额－后端（认）申购费用－赎回费用

例六：某投资者赎回100,000份B类基金份额，对应的后端申购费率是1.0%，赎回费率为0.1%，假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.016元，申购时的A/B类基金份额净值为1.010元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=100,000×1.016=101,600元

后端申购费用=100,000×1.010×1.0%=1,010.00元

赎回费用=101,600×0.1%=101.60元

赎回金额=101,600-1,010.00-101.60=100,488.40元

即：投资者赎回100,000份B类基金份额，对应的赎回费率为0.1%，假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.016元，投资者对应的后端申购费率是1.0%，申购时的A/B类基金份额净值为1.010元，则其可得到的赎回金额为100,488.40元。

（c）C类基金份额的赎回

投资者赎回C类基金份额，赎回金额的计算方法如下：

赎回金额=赎回份数×赎回当日C类基金份额净值

例七：某投资者赎回100,000份C类基金份额，假设赎回当日C类基金份额净值是1.250 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=100,000×1.250=125,000.00 元

即：投资者赎回100,000份C类基金份额，假设赎回当日C类基金份额净值是1.250元，则其可得到的赎回金额为125,000.00元。

（5）转换费

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

2）转出基金的赎回费用

转出基金的赎回费用按照各基金最新的更新招募说明书及相关公告规定的赎回费率和计费方式收取，赎回费用的25%归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3）前端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从不收取申购费用的基金或前端申购费用低的基金向前端申购费用高的基金转换，收取前端申购补差费用；从前端申购费用高的基金向前端申购费用低的基金或不收取申购费用的基金转换，不收取前端申购补差费用。申购补差费用原则上按照转出确认金额对应分档的转入基金前端申购费率减去转出基金前端申购费率差额进行补差，转出与转入基金的申购补差费率按照转出确认金额分档，并随着转出确认金额递减。

4）后端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从不收取申购费用的基金或后端申购费用低的基金向后端申购费用高的基金转换，不收取后端申购补差费用，但转入的基金份额赎回的时候需全额收取转入基金的后端申购费；从后端申购费用高的基金向后端申购费用低的基金或不收取申购费用的基金转换，收取后端申购补差费用，且转入的基金份额赎回的时候需全额收取转入基金的后端申购费。后端申购补差费用按照转出份额持有时间对应分档的转出基金后端申购费率减去转入基金后端申购费率差额进行补差。

5）网上直销的申购补差费率优惠

为更好服务投资者，本基金管理人已开通基金网上直销业务，个人投资者可以通过“网上直销交易平台”办理基金转换业务，其中部分转换业务可享受转换费率优惠，优惠费率只适用于转出与转入基金申购补差费用，转出基金的赎回费用无优惠。可通过网上直销交易平台办理的转换业务范围及转换费率优惠的具体情况请参阅本基金管理人网站。

具体转换费率水平请参见本基金管理人网站（www.fund001.com，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：

转出确认金额=100,000×1.010=101,000元

转出基金的赎回费=101,000×0.5%=505元

转入确认金额=101,000-505=100,495元

转出与转入基金的申购补差费=100,495×0/（1+0）=0元

转入基金确认份额=（100,495-0）/2.2700=44,270.93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：

转出确认金额=1,000,000×1.0200=1,020,000元

转出基金的赎回费=1,020,000×0.05%=510元

转入确认金额=1,020,000-510=1,019,490元

转出与转入基金的申购补差费=1,019,490×0.5%/（1+0.5%）=5,072.09元

转入基金确认份额=（1,019,490-5,072.09）/1.010=1,004,374.17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：

转出确认金额=100,000×1.2500=125,000元

转出基金的赎回费=0元

转入确认金额=125,000-0=125,000元

转出与转入基金的申购补差费=125,000×1.5%/（1+1.5%）=1,847.29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=100,000×1.00=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=100,000×0.8%/（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×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

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=100,000×1.250=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业务，个人投资者可以直接通过本公司网站的“交银施罗德基金管理有限公司网上直销交易平台”（以下简称“网上直销交易平台”）办理开户和本基金的申购、赎回、定期定额投资和转换等业务。本公司暂不开展网上直销本基金B类基金份额的认/申购业务，通过转托管转入网上直销账户的本基金B类基金份额只能办理赎回业务。通过网上直销交易平台办理本基金A类基金份额申购和定期定额投资业务的个人投资者将享受前端申购费率优惠，通过网上直销交易平台进行基金转换，从各基金招募说明书所载的零申购费率的基金转换入非零申购费率的基金，转出与转入基金的前端申购补差费率将享受优惠，其他费率标准不变。具体优惠费率请参见公司网站列示的网上直销交易平台申购、定期定额投资及转换费率表或相关公告。

本公司基金网上直销业务已开通的银行卡及各银行卡交易金额限额请参阅本公司网站。

个人投资者通过本基金管理人网上直销交易平台申购本基金A类、C类基金份额的单笔最低金额为100元（含），单笔定期定额投资最低金额为100元（含），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）基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（9）基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资人适当调低基金申购费率、赎回费率和转换费率。

**（三）不列入基金费用的项目**

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

**（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和C类基金份额销售服务费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率和C类基金份额销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒体上刊登公告。**

**（五）基金税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

**十四、对招募说明书更新部分的说明**

**总体更新**

本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下：

（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“六、基金的募集”中相关内容。

（六）更新了“七、基金合同的生效”中相关内容。

（七）更新了“八、基金份额的申购与赎回”中相关内容。

（八）增加了“九、基金的转换”中相关内容。

（九）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6月30日。

（十）更新了“十一、基金的业绩”中相关内容，数据截止到2014年6月30日。

（十一）更新了“十五、基金的费用与税收”中相关内容。

（十二）更新了“二十二、对基金份额持有人的服务”中相关内容。

（十三）更新了“二十三、其他应披露事项”中本次招募说明书更新期间，涉及本基金的相关信息披露。

交银施罗德基金管理有限公司

 二〇一四年九月十一日