交银施罗德增利债券证券投资基金(更新)招募说明书摘要

(2009年第1号)

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

【重要提示】

交银施罗德增利债券证券投资基金(以下简称"本基金")经2008年2月13日中国证券监督管理委员会证监许可【2008】239号文核准募集。本基金基金合同于2008年3月31日正式生效。

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

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

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前,需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认(申)购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金投资债券引发的信用风险,以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金是一只债券型基金,属证券投资基金中的中等风险收益品种。

投资有风险,投资人在认(申)购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2009年3月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2009年3月31日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:交银施罗德基金管理有限公司
住所:上海市交通银行大楼二层(裙)
办公地址:上海市浦东新区世纪大道201号渣打银行大厦10楼
邮政编码:200120
法定代表人:彭纯
成立时间:2005年8月4日
注册资本:贰亿元人民币
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

彭纯先生,董事长,博士学历。历任新疆财经学院讲师、教研室主任、科研处副处长、经济研究所副所长;新疆维吾尔自治区党委政研室副处长、处长;1994年起历任交通银行乌鲁木齐分行副行长、行长,南宁分行行长,广州分行行长,交通银行总行行长助理;现任交通银行执行董事、副行长。

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。

莫泰山先生,董事,总经理,硕士学历。历任中国证券监督管理委员会基金监管部副处长、办公厅主席秘书、基金监管部处长、交银施罗德基金管理有限公司副总经理。

阮红女士,董事,博士学历。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,现任交通银行投资管理部总经理。

吴伟先生,董事,博士学历。历任交通银行总行财会部财务处主管、副处长,总行预算财务部副总经理,现任交通银行总行预算财务部总经理。

葛礼达先生,董事,大专学历。历任施罗德集团信息技术工作集团信息技术部董事、施罗德集团首席营运官,现任施罗德集团亚太地区总裁。

孙祁祥女士,独立董事,博士学历、国务院政府特殊津贴专家、博士生导师。现任北京大学经济学院副院长、风险管理及保险学系主任。

王松奇先生,独立董事,博士学历。历任中国人民大学讲师、中国社会科学院财贸所金融研究中心研究员,现任中国社会科学院金融研究中心副主任、研究员,北京创业投资协会常务副理事长、秘书长。

陈家乐先生,独立董事,博士学历。历任香港科技大学金融学系副教授、教授,现任香港科技大学金融学系系主任。

2、基金管理人监事会成员

徐俊康先生,监事长,学士学历。曾任职于中国人民银行长宁区办事处和工商银行长宁区办事处,历任交通银行上海分行人事教育处副处长,交通银行人事教育部副总经理、总经理,交通银行党委委员、纪委书记。

金玉凤女士,监事,学士学历。历任海通证券有限公司办公室副主任(主持工作)、交通银行信托部主任科员、交通银行基金托管部综合处副处长、交通银行资产托管部客户服务处处长,现任交银施罗德基金管理有限公司总经理助理。

裴关淑仪女士,监事,CFA、CIPM、FRM,双硕士学位。历任施罗德投资管理(香港)有限公司资讯科技部主管、业务延续计划的负责人。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员,负责营运及IT部分。现任交银施罗德基金管理有限公司监察稽核及风险管理总监。

3、公司高管人员

彭纯先生,董事长,博士学历。简历同上。

莫泰山先生,董事,总经理,硕士学历。简历同上。

吴建中先生,督察长,大专学历。历任交通银行宁波分行副行长、行长、交通银行风险资产管理部副总经理、总经理、交通银行宁波分行行长、党委书记。

许珊燕女士,副总经理,硕士学历,高级经济师。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。经公司第二届董事会第三次会议审议通过,决定聘任谢卫先生担任公司副总经理。

4、本基金基金经理

陈晓秋女士,基金经理,硕士学历。7年基金公司债券研究及投资经验。曾任富国基金管理有限公司研究策略部和投资部研究员,负责债券及宏观分析、债券投资。2005年加入交银施罗德基金管理有限公司。2006年1月20日起担任交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理至今。2008年3月31日起兼任本基金基金经理至今。

李家春先生,基金经理,学士学历。10年证券、基金从业经历。历任长江证券有限责任公司投资经理,汉唐证券有限责任公司高级经理、投资主管,泰信基金管理有限公司高级研究员。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司。2006年12月27日起担任交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理至今。2008年3月31日起兼任本基金基金经理至今。

5、投资决策委员会成员

主席:李旭利(投资总监)
委员:莫泰山(总经理)
华昕(研究总监)
周炜炜(权益部副总经理)
项廷锋(固定收益部总经理)

上述人员之间无近亲属关系。

二、基金托管人

(一)、基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:尹东
联系电话:(010)6759 5003

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代号:HK0939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后建设银行的已发行股份总数为:233,689,084,000股(包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股)。2008年,中国建设银行的综合盈利能力和资产质量继续同业领先,截止2008年6月30日,中国建设银行实现净利润586.92亿元,同比增长71.34%。年化平均资产回报率为1.72%,年化平均股东权益回报率为26.36%,分别较上年同期提高0.54个百分点和6.56个百分点,每股盈利为0.25元,同比增长0.10元。总资产达到70,577.06亿元,较上年末增长6.96%。资产质量稳步上升,不良贷款额和不良贷款率实现双降,信贷资产质量持续改善,不良贷款率为2.21%,较上年末下降0.39个百分点。拨备水平充分,拨备覆盖率为117.23%,较上年末提升12.82个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行,在伦敦、纽约、悉尼设有代表处。2006年12月,中国建设银行在香港收购了美国银行在香港的全资子公司美国银行(亚洲)股份有限公司100%的股权,美国银行(亚洲)有限公司更名为"中国建设银行(亚洲)股份有限公司"。

2008年上半年,中国建设银行在美国《福布斯》杂志公布的世界银行500强中列第18位;被英国《福布斯》杂志评为全球上市公司2000强第69位;被英国《金融时报》评为"全球500强"第62位;在英国《金融时报》公布的全球市值500强中列第20位;在美国《财富》杂志全球企业500强排名中列第171位,较上年大幅提升59位;荣获英国《欧洲货币》杂志「最佳房地产投资奖」、香港《资本》杂志「中国杰出零售银行」,万事达国际组织「最佳商务卡奖」、「最佳联名卡奖」、「最佳产品设计奖」和香港《财资》杂志「中国最佳托管银行」等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室,现有员工110余人。2008年,中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会(AICPA)颁布的审计准则公告第70号(SAS70)进行的内部控制审计,并被安永会计师事务所评价为"业内最干净的无保留意见的报告",中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

2、主要人员情况

罗中涛,投资托管服务部总经理,曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作,对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部,对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

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

3、基金托管业务经营情况

截止到2008年12月31日,中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、通乾、银丰等7只封闭式证券投资基金,以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置3只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华－道琼斯88精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华安上证180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银效率优选、中小企业板ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信精选平衡、鹏华价值优势、中信稳定债券、华安宏利、上投摩根成长先锋、博时价值增长贰号、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚精萃成长、工银瑞信稳健成长、信达澳银领先增长、诺德价值优势、工银瑞信增强收益债券、国泰金鼎价值、富国天博、融通领先成长、华宝兴业行业精选、工银瑞信红利、泰达荷银市值优选、长城品牌优选、交银施罗德蓝筹、华夏全球精选、易方达增强回报、南方盛元红利、交银施罗德增利、工银瑞信信用添利、宝盈资源优选、华安稳定收益、兴业社会责任、华宝兴业海外中国成长、海富通全球精选中国概念、宝盈增强收益、鹏华丰收债券、博时特许价值、华富收益增强、信诚盛世蓝筹、东方策略成长、中欧新蓝筹混合、汇丰晋信2026生命周期混合、信达澳银精华配置混合、大成强化收益债券、交银环球精选价值、长城稳健增利债券、华商盛世成长股票、信诚三得益债券、长盛积极配置债券、鹏华盛世创新股票、华安核心优选股票、富国天丰强化收益债券、光大保德信增利收益债券、诺德主题灵活配置混合、东吴优信稳健债券、银华增强收益债券、东方稳健回报债券、华富策略精选混合基金等89只开放式证券投资基金。

(二)、基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

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

2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内控管理工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

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

(三)、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"托管业务综合系统——基金监督子系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

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

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

(3)、根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

(4)、通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1. 直销机构

机构名称:交银施罗德基金管理有限公司
住所:上海市交通银行大楼二层(裙)
办公地址:上海市浦东新区世纪大道201号渣打银行大厦10楼
法定代表人:彭纯
成立时间:2005年8月4日
电话:(021)61055023
传真:(021)61055054
联系人:张蓉
客户服务电话:400-700-5000(免长途话费),(021)61055000
网址:www.jysld.com,www.bocomschroder.com

个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金A类和C类基金份额的开户、申购、赎回、转换及定期定额投资等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:www.jysld.com,www.bocomschroder.com

2. 代销机构

场外代销机构

(1)中国建设银行
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

(2)中国工商银行股份有限公司
住所:北京市复兴门内大街55号
办公地址:北京市复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
电话:(010)66107900
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn

(3)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:项俊波
传真:(010)85109219
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com

(4)中国银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
传真:(010)66594853
客户服务电话:95566
网址:www.boc.cn

(5)中国邮政储蓄银行有限责任公司
住所:北京市西城区宣武门西大街131号
办公地址:北京市西城区宣武门西大街131号
法定代表人:刘安东
传真:(010)66415194
联系人:陈春林
客户服务电话:11185
网址:www.psbc.com

(6)交通银行
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:胡怀邦
电话:(021)58781234
传真:(021)58408842
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(7)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:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195109
联系人:万丽
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com

(8)上海银行股份有限公司
住所:上海市银城中路168号
办公地址:上海市银城中路168号
法定代表人:陈辛
电话:(021)68475888
传真:(021)68476111
联系人:张萍
客户服务电话:(021)962888
网址:www.bankofshanghai.com

(9)广东发展银行股份有限公司
住所:广州市农林下路83号
法定代表人:李若虹
联系人:詹全鑫、张大奕
客户服务电话:(020)38322542、38322974、38322730
网址:www.gdb.com.cn

(10)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:孔丹
电话:(010)65557013
传真:(010)65550827
联系人:金蕾
客户服务电话:95558
网址:bank.ecitic.com

(11)中国民生银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
电话:(010)58351666
传真:(010)83914283
联系人:董云巍、吴海鹏
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

(12)中国光大银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
办公地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
电话:(010)68098778
传真:(010)68560661
联系人:李伟
客户服务电话:95595
网址:www.cebbank.com

(13)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:徐浩明
电话:(021)68816000
传真:(021)68815009
联系人:刘晨
客户服务电话:10108998
网址:www.ebscn.com

(14)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市延平路135号
法定代表人:祝幼一
电话:(021)62580818
传真:(021)62569400
联系人:芮敏祺
客户服务电话:400-8888-666、(021)962588
网址:www.gtja.com

(15)中信建投证券有限责任公司
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:黎晓宏
电话:(010)65186080
传真:(010)65182261
联系人:魏明
客户服务电话:400-8888-108(免长途费)
网址:www.csc108.com

(16)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:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:(021)53594566
传真:(021)53858549
联系人:金芸、杨薇
客户服务电话:400-8888-001,(021)962503
网址:www.htsec.com

(17)广发证券股份有限公司
住所:广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址:广州市天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼
法定代表人:王志伟
传真:(020)87555305
联系人:肖中梅
客户服务电话:95575或致电各地营业网点
网址:www.gf.com.cn

(18)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:肖时庆
电话:(010)66568587
联系人:郭京华
客户服务电话:800-820-1868
网址:www.chinastock.com.cn

(19)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38－45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
电话:(0755)82943666
传真:(0755)82943636
联系人:黄健
客户服务电话:400-8888-111,95565
网址:www.newone.com.cn

(20)兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路99号标力大厦
办公地址:上海陆家嘴东路166号中保大厦
法定代表人:兰荣
电话:(021)68419974
传真:(021)68419867
联系人:杨盛芳
客户服务电话:(021)68419974
网址:www.xyzq.com.cn

(21)中信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区湖贝路1030号海龙王大厦
办公地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层
法定代表人:王东明
电话:(010)84588266
传真:(010)84865560
联系人:陈忠
客户服务电话:(010)84588903
网址:www.cs.ecitic.com

(22)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:黄维琳
客户服务电话:(021)962505
网址:www.sw2000.com.cn

(23)联合证券有限责任公司
住所:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人:马昭明
电话:(0755)82492000
传真:(0755)82492962
联系人:盛宗凌
客户服务电话:400-8888-555,(0755)25125666
网址:www.lhzq.com

(24)湘财证券有限责任公司
住所:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:上海浦东陆家嘴环路958号华能联合大厦五层
法定代表人:陈学荣
电话:(021)68634518
传真:(021)68865680
联系人:钟康莺
客户服务电话:400-888-1551或当地营业部客服电话
网址:www.xcsc.com

(25)国都证券有限责任公司
住所:深圳市福田中心区金田路4028号荣超经贸中心26层11、12
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
法定代表人:王少华
客户服务电话:800-810-8809
网址:www.guodu.com

(26)华泰证券股份有限公司
住所:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:(025)84457777-950、248
传真:(025)84579778
联系人:李金龙、张小波
客户服务电话:(025)95597
网址:www.htsc.com.cn

(27)中信金通证券有限责任公司
住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人:刘军
电话:(0571)85783715
传真:(0571)85783771
联系人:王勤
客户服务电话:(0571)96598
网址:www.96598.com.cn

(28)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:唐新宇
联系人:张静
客户服务电话:400-620-8888
网址:www.bocichina.com

(29)中信万通证券有限责任公司
住所:青岛市东海西路28号
法定代表人:史洁民
客户服务电话:(0532)96577
网址:www.zxwt.com.cn

(30)恒泰证券股份有限公司
住所:内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号
法定代表人:刘汝军
客户服务电话:(0471)4960762,(021)68405273
传真:(021)68405181
网址:www.cnht.com.cn

(31)国信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦
法定代表人:何如
电话:(0755)82130833
传真:(0755)82133302
联系人:齐晓燕
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

(32)国元证券股份有限公司
住所:安徽省合肥市寿春路179号
办公地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
客户服务电话:400-8888-777
网址:www.gyzq.com.cn

(33)东北证券股份有限公司
住所:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
电话:(0431)85096709
联系人:潘锴
客户服务电话:(0431)96688-0,(0431)85096733
网址:www.nesc.cn

(34)江南证券有限责任公司
住所:南昌市抚河北路291号
办公地址:南昌市抚河北路291号
法定代表人:姚江涛
电话:(0791)6768763
传真:(0791)6789414
联系人:余雅娜
客户服务电话:(0791)6768763
网址:www.scstock.com

(35)安信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
电话:(0755)82558305
传真:(0755)82558355
联系人:陈剑虹
客户服务电话:400-800-1001
网址: www.axzq.com.cn

(36)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:北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层
法定代表人:汤世生
电话:(010)62294608-6240
传真:(010)62296854
联系人:李茂俊
客户服务电话:(010)62294600
网址:www.hysec.com

(37)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:(021)63219781
传真:(021)51062920
联系人:李良
客户服务电话:4008-888-999,(027)85808318
网址:www.95579.com

(38)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:方加春
电话:(021)68761616
传真:(021)68767981
客户服务电话:4008-888-128
网址:www.tebon.com.cn

(39)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:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
电话:(010)66045529
传真:(010)66045500
联系人:莫晓丽
客户服务电话:(010)66045678
网址:www.txsec.com,www.txjijin.com

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

http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg_szjjt.jsp

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)登记结算机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:陈耀先
电话:(010)58598839
传真:(010)58598907
联系人:朱立元

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海源泰律师事务所
住所:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
联系人:廖海
经办律师:吴军娥、毛慧

(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有限公司
住所:上海市浦东新区东昌路568号
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:金毅
经办注册会计师:薛竞、金毅

四、基金的名称

本基金名称:交银施罗德增利债券证券投资基金

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

本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势,自上而下进行宏观分析,自下而上精选个券,在控制信用风险、利率风险、流动性风险前提下,主要通过投资承担一定信用风险、具有较高息票率的债券,实现基金资产的长期稳定增长。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票、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,其中股票投资仅限于参与新股认购和可转债转股获得的股票,权证投资仅限于参与可分离转债申购而获得的权证,即本基金不从二级市场购买股票或权证。本基金通过新股认购策略所认购新发行股票,在其上市后持有时间不超60个交易日,所持可转换债券转股后的股票持有时间不超过5个交易日,通过可转债认购所获得的权证,在其上市后持有时间不超过20个交易日。本基金的投资对象重点为承载一定信用风险、具有较高息票率的债券,包括企业债、公司债、短期融资券、次级债、资产支持证券(含资产收益计划)、可转换债券等以企业为主体发行的债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,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(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、次级债、可转换债券等)占基金资产的比例为80%-100%,其中次级债、资产支持证券(含资产收益计划)和可转换债券占基金资产的比例为0-40%,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;股票、权证等资产占基金资产的比例为0-20%,其中权证资产占基金资产净值的比例为0-3%。在基金实际管理过程中,本基金具体配置比例由基金管理人根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化做主动调整,以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡,但比例不超出基金合同约定的限定范围。

八、基金的投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的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,动态调整大类金融资产比例,自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置;同时在对企业债券进行信用评级的基础上,综合考量企业债券(含公司债、企业短期融资券)的信用评级以及包括其它券种在内的债券流动性、供求关系、收益率水平等因素,自下而上地配置债券类属和精选个券。通过综合运用骑乘操作、套利操作、新股认购等策略,提高投资组合收益。

1、资产配置策略

本基金采用"自上而下"的多因素分析决策支持系统,结合定性分析和定量分析,形成对不同类属市场的预测和判断,确定债权类证券、股权类证券和货币市场工具的配置比例,并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整类属资产的投资比例,以规避或控制市场风险,提高基金收益率。

2、久期管理策略

久期管理策略是债券型基金最基本的投资策略。久期管理策略在本质上是一种自上而下的策略,其目的在于通过合理的久期控制实现对利率风险的有效管理。

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久期。

具体而言,基金管理人通过以下几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:通过对宏观经济数据如月度、季度进出口增长率、消费增长率、投资增长率等的跟踪与分析,预测宏观经济运行趋势,合理预期当前经济运行在经济周期中所处的阶段;针对当前的经济运行存在的问题,合理预期中央政府的财政与货币政策取向以及当前利率在利率周期中所处的阶段。

(2)市场利率变动趋势分析:基于利率周期运行阶段的预期,密切关注月度CPI、PPI等物价指数、准备金比率、货币供应量、信贷、汇率等金融运行数据、投资、贸易顺差、工业增加值等实体经济运行数据以及就业数据等等央行货币政策所监控的目标数据的变化,预测法定利率在时间与空间上的变动与趋势。根据法定利率的变化,分析投资人心理与市场供求关系以及流动性等的变化,合理预期市场利率、债券收益率在时间与空间上的可能变动。

(3)目标久期分析:根据法定利率与市场利率的变动趋势、所处利率周期的阶段,结合当期的债券收益率水平,确定组合目标久期。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。

3、企业债投资策略

企业债投资策略是一种自上而下的利率风险管理与自下而上的信用风险管理相结合的策略,是本基金最主要的投资策略。本基金所指企业债券,包括公司债和企业短期融资券。

本基金通过宏观经济运行、企业发展前景、企业偿债能力、建设项目质量等多重因素的综合考量对企业债券进行信用评级,并在信用评级的基础上,建立企业债债券池;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,主要通过以下几个步骤来对企业债券进行投资管理:

(1)信用评级分析:本基金首先将企业债划分成短期企业债券(含企业短期融资券)和中长期企业债券(含中长期公司债),分别建立短期企业债券和中长期企业债券的信用评级指标体系,然后再利用信用评级指标体系给发行主体和标的债券打分,给出企业债基于其综合得分的信用评级等级。

(2)筛选企业债券:本基金将企业债的信用评级分成五级(见下表),而仅将信用评级在3级以上的债券纳入备选债券池(其中国债、央行票据、政策性金融债和银行担保的信用评级为AAA级或等同于AAA级的债券,自动纳入备选债券池)。本基金基金经理可直接按流程、按权限从备选债券池中选择债券进行投资。备选债券池外债券,信用评级为2级的企业债在信用评级没有改善迹象前限制投资,在投资评级出现改善趋势时,可以按流程、按权限少量投资;信用评级为1级的企业债禁止投资。

信用评级	综合得分	定义	投资建议
5	[90,100)	信用风险小	可投资
4	[80,90)	信用风险较小	可投资
3	[60,80)	信用风险中	可投资
2	[40,60)	信用风险大	限制投资
1	[0,40)	信用风险很大	禁止投资

3)信用利差分析:鉴于发达国家成熟市场"信用利差之谜"现象的广泛存在,信用产品本金损失率对信用利差解释力不高。本基金将根据中国企业债市场处于发展初级阶段,市场效率不高的现状,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。

4、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、资产池结构以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;通过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、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

5、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。一方面,本基金可转换债券股性的研究将完全依托于公司投研团队对标的股票的研究,在此基础上结合金融工程师的可转债定价模型,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。另一方面,对于本基金可转换债券债性的研究,将通过引进公司企业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,力求选择被市场低估的品种,来构建本基金可转换债券的投资组合。

6、股票投资策略

本基金股票投资策略包括新股认购策略和可转换债券转股策略。

(1)新股认购策略

本基金认为股票一、二级市场之间存在一定的价差是暂时现象,因此,股票投资策略只是一种阶段性投资策略。

本基金将通过分析影响股票一级市场资金面的相关市场风险收益特征的变化、股票发行政策取向(如扩容节奏、发行市盈率与二级市场市盈率的差距),预测新股一级市场供求关系的变化,并据此进一步预测认购新股中签率和新股的收益率变动趋势;同时,借助公司投资平台行业研究员的研究建议,预测拟认购新股的中签率和认购收益率,确定合理规模的资金、精选个股认购,实现新股认购收益率的最大化。

(2)可转换债券转股策略

本基金在进行可转换债券投资时,面对可能出现可转换债券与正股之间存在套利机会的现象或者出现可转换债券流动性暂时不足的现象,采用可转换债券转股策略,即将持有的可转换债券在转换期内转股抛售,以更好的保护基金投资人利益、实现基金可转换债券投资收益最大化。

本基金通过新股认购策略所认购新发行股票,在其上市后持有时间不超60个交易日,所持可转换债券转股后的股票持有时间不超过5个交易日;本基金累计持有股票余额不超过基金资产净值的20%。

7、权证投资策略

与新股认购策略一样,本基金认为权证投资策略也是一种阶段性投资策略。

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。

本基金通过可转债认购所获得的权证,在其上市后持有时间不超过20个交易日。

九、基金的业绩比较基准

本基金的整体业绩比较基准采用:

中债企业债总指数

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数,则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意后调整本基金的业绩评价基准并报中国证监会备案,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

本基金是一只债券型基金,在证券投资基金中属于中等风险的品种,其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金。

十一、基金投资组合报告

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

本基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于2009年4月17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2009年1月1日至2009年3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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	556,155.00	0.01
	其中:股票	556,155.00	0.01
2	固定收益投资	7,227,146,963.33	88.21
	其中:债券	7,046,240,783.68	86.00
	资产支持证券	180,906,179.65	2.21
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	716,116,922.99	8.74
6	其他资产	249,516,514.01	3.05
7	合计	8,193,336,555.33	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采掘业	–	–
C	制造业	556,155.00	0.01
C0	食品、饮料	–	–
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	–	–
C5	电子	556,155.00	0.01
C6	金属、非金属	–	–
C7	机械、设备、仪表	–	–
C8	医药、生物制品	–	–
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	–	–
H	批发和零售贸易	–	–
I	金融、保险业	–	–
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	–	–
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	556,155.00	0.01

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	002257	立立电子	25,500	556,155.00	0.01

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	71,982,779.30	1.05
2	央行票据	1,368,501,000.00	20.00
3	金融债券	1,929,709,000.00	28.20
	其中:政策性金融债	1,849,564,000.00	27.03
4	企业债券	2,627,405,324.14	38.39
5	企业短期融资券	608,871,500.00	8.90
6	可转债	439,771,180.24	6.43
7	其他	–	–
8	合计	7,046,240,783.68	102.96

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	080216	08国开16	7,500,000	798,975,000.00	11.67
2	0801044	08央行票据44	6,500,000	689,195,000.00	10.07
3	0801047	08央行票据47	3,500,000	371,245,000.00	5.42
4	080218	08国开18	3,200,000	327,488,000.00	4.79
5	088031	08天保投资债	2,800,000	302,288,000.00	4.42

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0830012	08开元1A2	2,000,000	77,440,000.00	1.13
2	0838014	08信银1B	400,000	39,960,000.00	0.58
3	0830013	08开元1B	300,000	29,796,000.00	0.44
4	119010	天电收益	400,000	20,096,773.70	0.29
5	119005	浦建收益	400,000	13,613,405.95	0.20

7、本基金本报告期末未持有权证 8、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	176,083.20
2	应收证券清算款	55,696,362.47
3	应收股利	–
4	应收利息	161,626,726.80
5	应收申购款	32,017,341.54
6	其他应收款	–
7	其他	–
8	合计	249,516,514.01

(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	110002	南山转债	229,677,177.00	3.36
2	125709	唐钢转债	102,236,386.14	1.49
3	110003	新钢转债	88,446,346.00	1.29
4	125528	柳工转债	11,704,378.40	0.17
5	110971	恒源转债	7,706,892.70	0.11

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002257	立立电子	556,155.00	0.01	网上申购新股流通受限

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2009年3月31日,所载财务数据未经审计师审计。

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

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

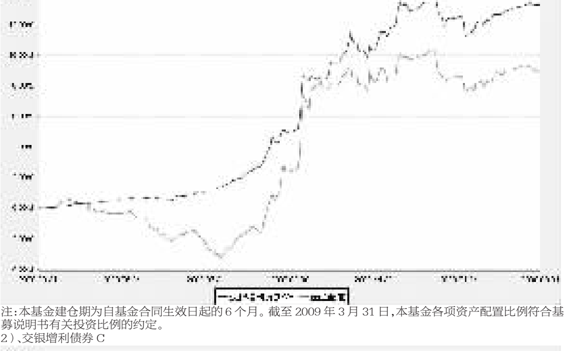
1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段		净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
A/B类	过去三个月	0.21%	0.18%	-0.86%	0.18%	1.07%	0.00%
	2008年度(自基金合同生效日起至2008年12月31日)	13.04%	0.20%	9.84%	0.30%	3.20%	-0.10%
	自基金合同生效日起至今	13.28%	0.19%	8.90%	0.28%	4.38%	-0.09%
C类	过去三个月	0.09%	0.18%	-0.86%	0.18%	0.95%	0.00%
	2008年度(自基金合同生效日起至2008年12月31日)	12.66%	0.20%	9.84%	0.30%	2.82%	-0.10%
	自基金合同生效日起至今	12.76%	0.19%	8.90%	0.28%	3.86%	-0.09%

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

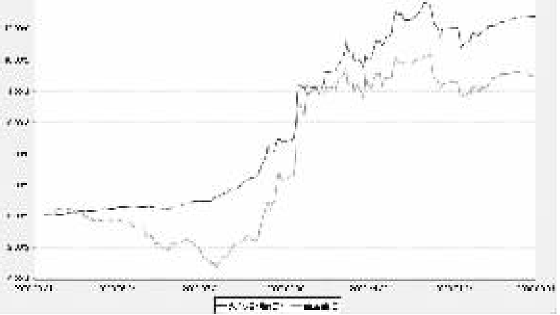
交银施罗德增利债券证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年3月31日至2009年3月31日)

1)、交银增利债券A/B



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2009年3月31日,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)、交银增利债券C



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2009年3月31日,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、基金财产拨划支付的银行费用;
4、基金合同生效后的基金信息披露费用;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
7、基金的证券交易费用;
8、本基金从C类基金份额的基金财产中计提销售服务费;
9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

本基金基金合同终止基金财产清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用

(1)基金管理人的管理费

基金管理人的管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%/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

基金管理费每日计算,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2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×2.5‰/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

基金托管费每日计算,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2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(3)上述(一)基金费用的种类中3－6、8项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,从基金财产中支付。

2、与基金销售有关的费用

(1)申购费

投资人申购A类基金份额收取前端申购费用,即在申购时支付申购费用,申购费率按每笔申购申请单独计算。投资人申购B类基金份额收取后端申购费用,即在赎回时才支付相应的申购费用,该费用随基金份额的持有时间递减。投资人申购C类基金份额不收取申购费用,而是从该类别基金资产中计提销售服务费。目前场内交易只支持A类基金份额的申购。

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。

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(含)以上	每笔交易1000元

本基金B类基金份额的申购费率如下:

持有时间	B类基金份额后端申购费率
1年以内(含)	1.0%
1年至3年(含)	0.6%
3年至5年(含)	0.4%
5年以上	0.0%

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。

(2)申购份额的计算

1)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)
申购费用＝申购总金额－净申购金额
申购份额＝[illegible]

例一:某投资人投资4万元申购本基金的A类基金份额(非网上交易),申购费率为0.8%,假设申购当日A/B类基金份额净值为1.0400元,则其可得到的申购份额为:

申购总金额＝40,000元
净申购金额＝40,000/(1+0.8%)=39,682.54元
申购费用＝40,000－39,682.54=317.46元
申购份额＝(40,000－317.46)/1.0400=38,156.29份

如果投资人是场内申购,申购份额为38,156份,其余0.29份对应金额返回给投资人。

2)B类基金份额的申购

申购总金额＝申请总金额
申购份额＝[illegible]

当投资人提出赎回时,后端认购费用的计算方法为:

后端申购费用＝赎回份额×T日A/B类基金份额净值×后端申购费率

例二:某投资人投资4万元申购本基金的B类基金份额,假设申购当日A/B类基金份额净值为1.0400元,则其可得到的申购份额为:

申购份额＝40,000/1.0400＝38,461.54份

即:投资人投资4万元申购本基金的B类基金份额,假设申购当日A/B类基金份额净值为1.0400元,则可得到38,461.54份B类基金份额,但其在赎回时需根据其持有时间按对应的后端申购费率交纳后端申购费用。

3)C类基金份额的申购

如果投资人选择申购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

例三:某投资人投资4万元申购本基金的C类基金份额,假设申购当日C类基金份额净值为1.0400元,则其可得到的申购份额为:

申购份额＝40,000/1.0400＝38,461.54份

即:投资人投资4万元申购本基金的C类基金份额,假设申购当日C类基金份额净值为1.0400元,则其可得到38,461.54份C类基金份额。

(3)赎回费用

赎回费用由A/B类基金份额赎回人承担,赎回费用的25%归基金财产,其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。投资人赎回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/B类基金份额的赎回费率如下:

持有期限	A/B类基金份额赎回费率
1年以内(含)	0.1%
1年至2年(含)	0.05%
2年以上	0.0%

(4)赎回金额的计算

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

1)A类基金份额的赎回

如果投资人赎回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

例一:某投资人赎回1万份A类基金份额,对应的赎回费率为0.10%,假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.0160元,则其可得到的赎回金额为:

赎回费用＝10,000×1.0160×0.10%＝10.16元
赎回金额＝10,000×1.0160－10.16＝10,149.84元

即:投资人赎回本基金1万份A类基金份额,假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.0160元,则其可得到的赎回金额为10,149.84元。

2)B类基金份额的赎回

如果投资人赎回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A/B类基金份额净值×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

例二:某投资人赎回1万份B类基金份额,对应的赎回费率为0.05%,假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.0160元,投资人对应的后端申购费是0.6%,申购时的A/B类基金份额净值为1.0100元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总额＝10,000×1.0160=10,160元
后端申购费用＝10,000×1.0100×0.6%=60.60元
赎回费用＝10,160×0.05%=5.80元
赎回金额＝10,160－60.60－5.80=10,093.60元

即:投资人赎回本基金1万份B类基金份额,对应的赎回费率为0.05%,假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.0160元,投资人对应的后端申购费是0.6%,申购时的A/B类基金份额净值为1.0100元,则其可得到的赎回金额为10,093.60元。

3)C类基金份额的赎回

投资人赎回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

例三:某投资者赎回本基金1万份C类基金份额,假设赎回当日C类基金份额净值是1.2500元,则其可得到的赎回金额为:

赎回金额＝10,000×1.2500=12,500元

即:投资者赎回本基金1万份C类基金份额,假设赎回当日C类基金份额净值是1.2500元,则其可得到的赎回金额为12,500元。

(5)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×年销售费率÷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

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

(6)转换费

本基金管理人于2007年12月11日刊登公告,自2007年12月14日起开通旗下交银施罗德精选股票证券投资基金(简称"交银精选")、交银施罗德货币市场证券投资基金(简称"交银货币")、交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金(简称"交银稳健")、交银施罗德成长股票证券投资基金(简称"交银成长")和交银施罗德增利债券证券投资基金(简称"交银蓝筹")间前端收费模式下的基金转换业务。

本基金管理人于2008年5月22日刊登公告,自2008年5月23日起开通交银施罗德增利债券证券投资基金(简称"交银增利")C类基金份额与前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长和交银蓝筹之间的转换业务。

本基金A类、C类基金份额与交银精选、交银货币、交银稳健、交银成长以及交银蓝筹前端收费模式下的转换费率按如下规定执行。

1)交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹之间的转换及由上述基金转入货币市场基金(交银货币)和交银增利C类基金份额,申购补差费用为0,投资人需支付转出基金的赎回费用,具体如下:

(下转C14版)