海富通稳健添利债券型证券投资基金

2009年第三季度报告

2009年9月30日

基金管理人：海富通基金管理有限公司 基金托管人：中国工商银行股份有限公司 报告送出日期：2009年10月29日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 10 月 28 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 7 月 1 日起至 2009 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称：	海富通稳健添利债券	
基金运作方式：	契约型开放式	
交易代码	519023	
基金合同生效日：	2008年10月24日	
报告期末基金份额总额：	679,069,517.24份	
投资目标：	在强调本金安全的基础上，积极追求资产长期稳健的增值。	
投资策略：	本基金通过价值分析，采用自上而下确定投资策略，采取久期管理、类属配置和现金管理策略等积极投资策略，发现、确认并利用细分市场失衡，实现组合增值。	
业绩比较基准：	中证全债指数	
风险收益特征：	本基金为债券型基金，属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人：	海富通基金管理有限公司	
基金托管人：	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称：	海富通稳健添利债券A	海富通稳健添利债券C
下属两级基金的交易代码：	519024	519023
报告期末下属两级基金的份额总额：	32,889,658.40份	646,179,858.84份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	A级基金报告期(2009-07-01 至 2009-09-30)	C级基金报告期(2009-07-01 至 2009-09-30)
1.本期已实现收益	-108,422.90	2,596,888.74
2.本期利润	-291,667.02	5,185,491.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0174	0.0081
4.期末基金资产净值	34,016,519.12	669,586,163.24
5.期末基金份额净值	1.034	1.036

注：（1）所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。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（3）海富通稳健添利债券型证券投资基金于 2009 年 3 月 13 日刊登公告，自 2009 年 3 月 18 日起增加一种新的收费模式 – A 类收费模式，该类别收取申购费和赎回费，不收取销售服务费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期 A 级基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

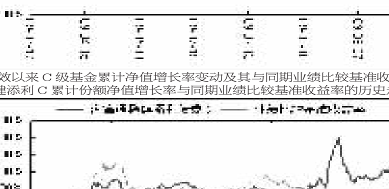
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去3个月	1.08%	0.24%	-0.67%	0.09%	1.75%	0.15%

本报告期 C 级基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去3个月	0.97%	0.23%	-0.67%	0.09%	1.64%	0.14%

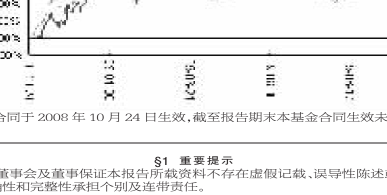
3.2.2 自基金合同生效以来 A 级基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通稳健添利 A 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



自基金合同生效以来 C 级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

海富通稳健添利 C 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2008 年 10 月 24 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

2、按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一章（二）投资范围、（六）投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邵佳民	本基金的基金经理；海富通强化回报混合基金基金经理；固定收益组合管理部总监	2008年10月24日	–	12年	中国国籍，硕士，持有基金从业人员资格证书。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003 年 4 月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师，2005 年 1 月至 2008 年 1 月担任海富通货币基金基金经理。2006 年 5 月起任海富通强化回报混合基金基金经理，2007 年 10 月起任固定收益组合管理部总监，2008 年 10 月起兼任海富通稳健添利债券基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司自成立以来，就建立了公平交易制度，并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度的执行。中国证监会于 2008 年 3 月 20 日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司根据该指导意见的具体要求，已完善现有的业务流程，建立了公平交易监控系统，进行定期监控，以切实保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

根据本基金合同，公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

（1）行情回顾及运作分析

2009 年第三季度，债券市场面临的压力有所减轻，主要表现在：政府试图通过对货币政策实行“微调”来控制信贷的增长速度，而受到放贷能力以及资本充足率等指标的限制，商业银行的贷款增长速度下降，股票等资产市场的上涨受到抑制。国际大宗商品价格上涨的速度减缓，投资者对未来利率上升的担忧暂时减弱。债券市场表现为短期品种保持稳定，中长期利率仍然有一定上升，尤其是信用品种。新股申购收益率保持在较高水平，减弱了债券的吸引力，尤其是对于不能够进行回购融资、期限较长的债券。受到股票市场降温的影响，可转换债券出现较大幅度的调整。

本基金在第三季度的债券组合没有大的变化，主要对短期品种进行了置换，将部分期限过短的品种置换为期限长一些的品种，同时降低了可转换债券的投资比例。本基金在第三季度积极参与新股的申购，这部分投资成为利润的主要来源。

（2）本基金业绩表现

报告期内，海富通稳健添利债券 C 类基金净值增长率为 0.97%，同期业绩比较基准收益率为 -0.67%；海富通稳健添利债券 A 类基金净值增长率为 1.08%，同期业绩比较基准收益率为 -0.67%。

（3）市场展望和投资策略

本基金认为，未来半年左右债券市场仍不乐观。主要原因是：世界主要经济体的货币政策目标尚未转向防范通货膨胀，对通货膨胀有一定的容忍；国内债券发行人的融资需求不断上升，但投资者在减少，债券市场的供求矛盾加剧，特别在新股申购收益率保持较高水平的条件下；国内货币政策可能从上半年的非常宽松调整为比较理想的适度宽松，市场各方对资金的竞争可能增加。

本基金将保持较短的组合久期，提高资产的流动性，提高防御能力，并以可转换债券、新股申购等提高基金的盈利能力，力争为投资者带来较好的回报，同时对新股高价发行带来的风险保持警惕。

§5 投资组合报告

5.1 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	31,494,669.16	4.46
	其中：股票	31,494,669.16	4.46
2	固定收益投资	591,522,728.00	83.74
	其中：债券	591,522,728.00	83.74
	资产支持证券	–	–
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	78,424,636.13	11.10
6	其他资产	4,938,884.57	0.70
7	合计	706,380,917.86	100.00

5.2 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	11,379,812.92	1.62
C0	食品、饮料	575,330.96	0.08
C1	纺织、服装、皮毛	577,704.60	0.08
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	889,148.16	0.13
C4	石油、化学、塑胶、塑料	–	–
C5	电子	957,353.82	0.14
C6	金属、非金属	546,272.00	0.08
C7	机械、设备、仪表	6,065,035.62	0.86
C8	医药、生物制品	1,768,967.76	0.25
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	15,582,797.72	2.21
F	交通运输、仓储业	1,720,859.49	0.24
G	信息技术业	954,412.25	0.14
H	批发和零售贸易	–	–
I	金融、保险业	–	–
J	房地产业	804,137.76	0.11
K	社会服务业	1,052,649.02	0.15
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	31,494,669.16	4.48

5.3 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	601668	中国建筑	2,084,411	9,671,667.04	1.37
2	601618	中国中冶	1,063,153	5,911,130.68	0.84
3	300003	乐普医疗	70,615	2,047,835.00	0.29
4	601107	四川成渝	249,039	1,720,859.49	0.24
5	002276	万马电缆	52,803	1,367,597.70	0.19
6	002294	信立泰	17,115	1,254,529.50	0.18
7	601888	中国国旅	89,359	1,052,649.02	0.15
8	002278	神开股份	39,497	904,481.30	0.13
9	002292	奥飞动漫	22,752	889,148.16	0.13
10	002283	天润曲轴	50,170	858,910.40	0.12

5.4 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	363,392,000.00	51.65
2	央行票据	49,145,000.00	6.98
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	158,031,066.00	22.46
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	20,954,662.00	2.98
7	其他	–	–
8	合计	591,522,728.00	84.07

5.5 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	010203	02国债(3)	1,600,000	162,000,000.00	23.02
2	020017	09贴债 17	1,200,000	119,184,000.00	16.94
3	010110	21国债(10)	800,000	82,208,000.00	11.68
4	0901040	09央行票据 40	500,000	49,145,000.00	6.98
5	126012	08上港债	400,000	38,740,000.00	5.51

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,830,354.99
5	应收申购款	858,529.58
6	其他应收款	–
7	其他	–
8	合计	4,938,884.57

5.8.4 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	125960	锡业转债	9,792,750.00	1.39

5.8.5 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	601668	中国建筑	9,671,667.04	1.37	网下申购中签流通受限
2	601618	中国中冶	5,911,130.68	0.84	网下申购中签流通受限
3	300003	乐普医疗	2,047,835.00	0.29	网下申购中签流通受限
4	601107	四川成渝	1,720,859.49	0.24	网下申购中签流通受限
5	002276	万马电缆	1,367,597.70	0.19	网下申购中签流通受限
6	002294	信立泰	1,254,529.50	0.18	网下申购中签流通受限
7	601888	中国国旅	1,052,649.02	0.15	网下申购中签流通受限
8	002278	神开股份	904,481.30	0.13	网下申购中签流通受限
9	002292	奥飞动漫	889,148.16	0.13	网下申购中签流通受限
10	002283	天润曲轴	858,910.40	0.12	网下申购中签流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	A级	C级
报告期期初基金份额总额	1,773,759.12	820,076,396.67
报告期期间基金总申购份额	33,878,425.11	228,927,592.03
报告期期间基金总赎回份额	-2,762,525.83	-402,824,129.86
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	–	–
报告期期末基金份额总额	32,889,658.40	646,179,858.84

§7 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 10 只开放式基金。截至 2009 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 354.2 亿元人民币。

2005 年 8 月，海富通率先获得国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人资格。截至 2009 年三季度末，正式投入运作的年金账户 40 余家，合计管理资产规模超过 90 亿元人民币。2007 年 8 月，海富通获得中国证监会核准的 QDII(合格境内机构投资者)业务资格。从 2004 年末开始，海富通为 QFII（合格境外机构投资者）及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问，截至 2009 年三季度末，投资咨询业务规模超过 210.46 亿元人民币，海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

2009 年以来，海富通旗下基金的业绩表现较为出色。根据晨星 Morning Star 排名，截至 2009 年 9 月 30 日，海富通风格优势股票基金今年以来净值增长率达到 57.18%，在股票型基金中位列前 1/4。根据银河证券同期排名，海富通首只 QDII 基金产品海富通中国海外股票（QDII）基金净值增长率在所有 9 只 QDII 基金中位列第一，截至三季度末，该基金今年以来净值增长率已高达 64.93%。

成立六年多来，海富通始终坚持“专业、专心、专注”的职业精神。2004 年 9 月，海富通在我国基金业内率先聘请全球著名资产管理人评估机构惠誉评级（Fitch Ratings）为公司进行资产管理业务评级，并于 2005 年、2006 和 2007 年连续获得"惠誉 M2（中国）"资产管理人优秀评级，在 2008 年复评中又被升级为"惠誉 M2+（中国）"资产管理人优秀评级，2009 年再度获得"惠誉 M2+（中国）"资产管理人优秀评级。惠誉认为，最新的这次评级，反映了海富通拥有具有可比性的在中国资产管理业的较长经验、组织的稳定性以及发展的可控性，也反映了海富通投资流程的质量和专用于投资管理的额外资源的质量，同时该评级还受益于海富通的公司治理标准和有高管充分监督的多层风险管理程序。

海富通同时还在不断践行其社会责任。自 2008 年启动“绿色与希望 – 橄榄枝公益环保计划”以来，先后捐赠了因汶川地震严重受灾的四川德阳什邡洛水小学、捐助内蒙古库伦旗植树壹万棵捐建公益林、向上海利民民工小学、华博利星行民工小学捐赠电脑、为安徽省金寨县杨山小学扶贫助学并捐赠教学物资、前往上海唐四民工小学担当志愿者等等。

此外，海富通还积极推进投资者教育工作，在与上海交大安泰经管学院合作建立的“海富通 – 上海交大投资者教育研究中心”推出的数万余字的投资者行为学调研报告 –《股市与幸福感》的基础上，海富通于三季度启动了新一轮投资者教育活动：海富通幸福投资行动。其中包括：为期三个月的“幸福投资路”网络游戏、海富通幸福投资大解码网络互动、理财周报 16 版幸福投资密码特刊、记者专访、有关幸福投资理念宣传的各类报刊栏目撰写等。

三季度内，海富通在《理财周报》举行的“2009 中国最受尊敬基金公司评选”活动中，海富通荣膺：“2009 最佳品牌塑造基金公司”、“2009 最受尊敬基金公司”，总裁田仁灿先生获评“2009 最受尊敬基金公司总裁：最具社会责任总裁”。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准设立海富通稳健添利债券型证券投资基金的文件
海富通稳健添利债券型证券投资基金基金合同
海富通稳健添利债券型证券投资基金招募说明书
海富通稳健添利债券型证券投资基金托管协议
中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
报告期内海富通稳健添利债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36、37 楼本基金管理人办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
2009年10月29日

交银施罗德保本混合型证券投资基金

2009年第三季度报告

2009年9月30日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司 基金托管人：中国工商银行股份有限公司 报告送出日期：二〇〇九年十月二十九日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 10 月 28 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 7 月 1 日起至 2009 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银保本混合
交易代码	519697
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月21日
报告期末基金份额总额	3,816,179,425.55份
投资目标	在确保保本周期到期时本金安全的基础上，通过保本资产与收益资产的动态配置和有效的组合管理，寻求组合资产的稳定增长和保本期间收益的最大化。
投资策略	本基金利用恒定比例组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）原理，动态调整保本资产与收益资产的投资比例，以实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金保证人	中国投资担保有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2009年7月1日 -2009年9月30日)
1.本期已实现收益	117,183,693.54
2.本期利润	-24,203,465.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0059
4.期末基金资产净值	3,930,183,668.20
5.期末基金份额净值	1.030

注：1、上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，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

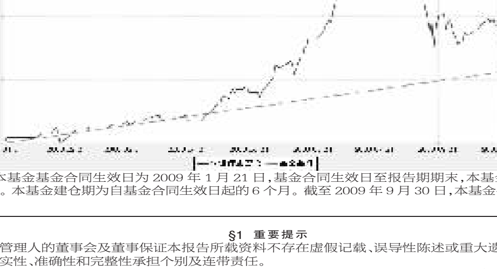
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.77%	0.32%	0.85%	0.01%	-1.62%	0.31%
自基金合同生效起至今	3.00%	0.22%	2.34%	0.01%	0.66%	0.21%

3.2.2 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

交银施罗德保本混合型证券投资基金

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

（2009 年 1 月 21 日至 2009 年 9 月 30 日）



注：本基金基金合同生效日为 2009 年 1 月 21 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 2009 年 9 月 30 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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张迎军	本基金的基金经理	2009-1-21	–	9年	张迎军先生，中国国籍。经济学硕士。历任申银万国证券研究所市场研究部、策略研究部研究员，中国太平洋保险（集团）股份有限公司资金运用管理中心投资经理，太平洋资产管理有限公司组合管理部组合经理。2008 年 8 月加入交银施罗德基金管理有限公司。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《交银施罗德保本混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司有严格的投资控制制度和风险监控制度来保证旗下基金运作的公平，报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率以及不同时间窗内（同日内、5 日内、10 日内）同向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本投资组合与公司旗下投资风格相似的其他投资组合之间的业绩表现未出现差异超过 5%的情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

随着央行重启 1 年期央票发行，宣告宽松货币政策退出逐渐拉开序幕。2009 年三季度央票利率发行上升导致债券市场短端利率上升，进而带动收益率曲线整体向上移动。三季度中债总净价指数下跌 1.5%，中债国债净价指数下跌 1.8%，中债企业债净价指数下跌 2.8%。本基金在年初开仓运作债券组合构建保本安全垫时，市场利率处于历史最低水平区间。本基金判断当时的债券市场是处于一轮大周期的顶部区域，央行宽松货币政策开始退出之时即是债券市场顶部构筑完成之时。因此，2009 年三季度本基金债券投资操作进一步降低债券组合久期，以规避利率上升对债券组合的冲击。2009 年三季度股票市场在上证综指 2700 点到 3500 点间巨幅震荡。在震荡市中，本基金对股票组合中银行、地产、煤炭等本轮涨幅较大股票在股价高位时减持，较好锁定了利润。由于及时降低股票仓位，在三季度震荡市中较好控制了本基金净值波动的下行风险。

展望 2009 年四季度债券市场，澳大利亚率先加息预示着各国为应对经济危机所采取超宽松货币政策相继退出的时间窗口或已为期不远。虽然中国 2009 年四季度加息的概率还不大，但预计中国经济复苏态势以及 CPI 同比即将在年底由负转正，使得市场利率总体上将继续处于上升态势，债券市场也将继续呈现空头市场格局。债券投资方面，本基金将严格控制债券组合久期，以规避利率上行的风险。

随着中国央行货币政策微调的出现，宣告金融市场流动性最宽松时期已经过去。2009 年八月份 A 股市场大幅调整，也预示着以估值水平不断提升的流动性推动行情基本结束，接下来股票市场上涨的主要动力将由流动性推动向业绩推动转化。在经济复苏的环境下，从 2009 年二季度起上市公司业绩开始环比大幅上升。可以预期，如果 2009 年上市公司业绩同比增长 18%以上，沪深 300 在 3100 点的 2009 年市盈率将回到 20 倍左右，这将为业绩推动行情的演变提供相应基础。股票投资方面，在控制风险的前提下，本基金着眼于 2010 年业绩有稳定增长预期的行业与股票，适度提高股票仓位，力争分享业绩推动行情带来的投资机会。

§5 投资组合报告

5.1 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	279,870,615.57	7.10
	其中：股票	279,870,615.57	7.10
2	固定收益投资	2,955,257,132.11	75.02
	其中：债券	2,840,132,132.11	72.10
	资产支持证券	115,125,000.00	2.92
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	400,000,195.00	10.15
	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	256,260,263.00	6.51
6	其他资产	47,929,237.34	1.22
7	合计	3,939,317,443.02	100.00

5.2 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	30,015,989.28	0.76
C	制造业	72,212,973.06	1.84
C0	食品、饮料	–	–
C1	纺织、服装、皮毛	577,704.60	0.01
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	14,679,331.16	0.37
C5	电子	11,650,536.55	0.30
C6	金属、非金属	20,023,972.07	0.51
C7	机械、设备、仪表	14,564,815.50	0.37
C8	医药、生物制品	9,777,697.54	0.25
C99	其他制造业	938,915.64	0.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	67,972,020.00	1.73
F	交通运输、仓储业	18,884,091.50	0.48
G	信息技术业	44,881,666.98	1.14
H	批发和零售贸易	11,940,000.00	0.30
I	金融、保险业	24,581,441.13	0.63
J	房地产业	804,137.76	0.02
K	社会服务业	8,578,295.86	0.22
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	279,870,615.57	7.12

5.3 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	601668	中国建筑	11,464,264	53,194,184.96	1.35
2	600583	海油工程	2,799,999	30,015,989.28	0.76
3	600718	东软集团	1,459,504	29,058,724.64	0.74
4	600030	中信证券	699,985	17,506,624.85	0.45
5	000088	盐田港	2,199,998	16,015,985.44	0.41
6	601618	中国中冶	2,657,884	14,777,835.04	0.38
7	000829	天音控股	2,000,000	11,940,000.00	0.30
8	002121	科陆电子	778,160	11,314,446.40	0.29
9	000651	格力电器	500,000	10,900,000.00	0.28
10	600309	烟台万华	619,909	10,687,231.16	0.27

5.4 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	536,230,000.00	13.64
3	金融债券	99,910,000.00	2.54
	其中：政策性金融债	99,910,000.00	2.54
4	企业债券	1,738,801,665.71	44.24
5	企业短期融资券	461,756,000.00	11.75
6	可转债	3,434,466.40	0.09
7	其他	–	–
8	合计	2,840,132,132.11	72.26

5.5 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	0801112	08央行票据 112	2,500,000	241,300,000.00	6.14
2	0881249	08电网 CP03	2,000,000	201,080,000.00	5.12
3	0901038	09央行票据 38	2,000,000	196,580,000.00	5.00
4	088050	08渝城投债	1,600,000	162,672,000.00	4.14
5	0981024	09铁道 CP01	1,500,000	150,030,000.00	3.82

5.6 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（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	0832011	08信元 1A	1,500,000	115,125,000.00	2.93

5.7 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权证投资明细

本基金本报告期末持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	649,073.40
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	47,280,163.94
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	47,929,237.34

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 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	601668	中国建筑	53,194,184.96	1.35	网下新股锁定期
2	601618	中国中冶	14,777,835.04	0.38	网下新股锁定期

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	4,460,290,131.33
报告期期间基金总申购份额	–
报告期期间基金总赎回份额	644,110,705.78
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	–
报告期期末基金份额总额	3,816,179,425.55

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德保本混合型证券投资基金募集的文件；
2、《交银施罗德保本混合型证券投资基金基金合同》；
3、《交银施罗德保本混合型证券投资基金招募说明书》；
4、《交银施罗德保本混合型证券投资基金托管协议》；
5、《交银施罗德保本混合型证券投资基金保函》；
6、关于申请募集交银施罗德保本混合型证券投资基金之法律意见书；
7、基金管理人业务资格批件、营业执照；
8、基金托管人业务资格批件、营业执照；
9、报告期内交银施罗德保本混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

7.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。

交银施罗德成长股票证券投资基金

2009年第三季度报告

2009年9月30日

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 报告送出日期：二〇〇九年十月二十九日

§1 重要提示

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。

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 2009 年 10 月 28 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 7 月 1 日起至 2009 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银成长股票
交易代码	519692
前端交易代码	519692
后端交易代码	519693
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月23日
报告期末基金份额总额	2,778,924,016.86份
投资目标	本基金属于成长型股票基金，主要通过投资于经过严格的品质筛选且具有良好成长性的上市公司的股票，在适度控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
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，通过优选成长性好、成长具有可持续性、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。
业绩比较基准	75%×新华富时 A600 成长指数 +25%×新华富时中国国债指数
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，以具有良好成长性的公司为主要投资对象，追求超额收益，属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险的品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2009年7月1日 -2009年9月30日)
1.本期已实现收益	799,469,983.21
2.本期利润	-285,080,640.27
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1002
4.期末基金资产净值	6,573,319,102.90
5.期末基金份额净值	2.3654

注：1、上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，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

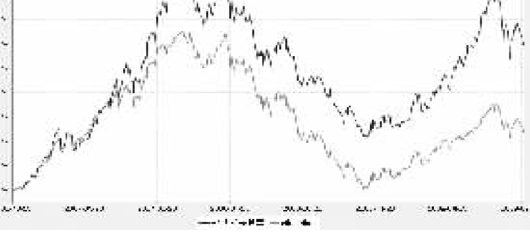
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.26%	2.38%	-3.23%	1.83%	-1.03%	0.55%
自基金合同生效起至今	152.81%	1.97%	61.73%	1.87%	91.08%	0.10%

3.2.2 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

交银施罗德成长股票证券投资基金

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

（2006 年 10 月 23 日至 2009 年 9 月 30 日）



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至 2009 年 9 月 30 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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周炜炜	本基金的基金经理，公司投资副总监、权益部总经理	2006-10-23	–	7年	周炜炜先生，中国国籍。CFA，伦敦商学院金融学硕士学位优异毕业生。历任德意志银行集团上海分行助理副总裁，美国思腾思特管理咨询公司中国区副总裁，招商基金管理有限公司基金管理部副总监和基金经理。2006 年加入交银施罗德基金管理有限公司。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《交银施罗德成长股票证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司有严格的投资控制制度和风险监控制度来保证旗下基金运作的公平，报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率以及不同时间窗内（同日内、5 日内、10 日内）同向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本投资组合与公司旗下投资风格相似的其他投资组合之间的业绩表现未出现差异超过 5%的情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

在三季度，政府开始逐步控制货币政策导致的流动性，以保持其合理和可持续的增长。市场在流动性是否仍然宽松、公司盈利的恢复是否强劲和市场整体估值是否合理的争论中，遭遇了较大的震荡。

展望四季度，本基金仍认为现在是投资股市较好的时间窗口：因为股市估值还是比较合理，中国和全球宏观经济的增长还会持续恢复，全球利率还会维持在较低的水平下，而全球企业的盈利还会持续变好。虽然政策面最宽松的时间可能已过去，但是政策的调整不会扼杀经济和盈利的复苏。以 A 股为例，预计未来三个季度的盈利增速都会不错，而通常来讲，A 股市场会提前反映盈利增速变化大约三个月左右的时间。从这个意义上讲，我们还会有一段比较不错的投资时间窗口。同时，从投资的结构看，经过 2009 年市场估值的恢复，明年市场会更加注重公司的内生性增长，或者是以资产注入、收购兼并为形式的外生性增长。更高的增长，不管是不是可持续的，都可能迎合不同类型的投资者，可能意味着更好的市场表现。

从更长的时间段来看，如果人民币的币值与美元的实质性挂钩的现状不变，那么，即使中国的资产价格现在还没有泡沫，未来泡沫化的可能性也在加大，原因仍在于：得益于美联储宽松的货币政策，美元很有可能成为新一轮利差交易（Carry Trade）的货币，并流向成长更好而杠杆更低的新兴市场国家。香港市场受外来资金流入的影响，很有可能形成相比于其在 90 年代针对成熟市场 10-20%估值溢价基础之上更高的溢价。原因是在本轮危机中，中国的国家信用风险大幅降低，而美国的国家信用风险却在上升，从而在本轮股市上涨中，投资中国不需要再像 90 年代一样承受较高的中国“国家风险”，从而提升港股的估值水平，并推动国内 A 股市场的估值。

从最近的情况来看，国际资金流入香港的趋势在加剧，从而使港股的表现远超 A 股。而国内外汇占款的新增又持续上升。这种外来资金的冲击，也影响了央行实施独立的货币政策的效果。我们在明年很有可能看到由于外汇占款上升的冲击，不管在香港还是中国内地，市场的上涨幅度可能超出大家的预期。

回到本基金的策略上，经过三季度的震荡，资产、资源类的股票的估值又渐趋合理。而由于西方主要资源消耗和进口国的货币竞相贬值，从而使得大宗商品和资源针对纸币上涨的长期趋势并没有改变，所以，自上而下看，超配资源型、资产性行业的战略方向还是基本不变。另外，三季度许多自下而上挑选的成长股的估值可能已被充分拉升，本基金会加强个股的估值分析，逐步降低对估值较高的个股的风险暴露。

本基金认为未来一段时间的市场风险可能来自于明年中期后。最有可能打破市场上涨趋势的风险主要来自于两个方面：

第一，海外市场，主要是美国市场。如果美国经济明年强劲复苏，从下半年开始美国可能要被迫实施紧缩政策。此时，全球流动性转向，新兴市场资产价格可能会有压力，尤其是新兴市场的资产价格已经大幅上扬之后。当然，如果届时新兴市场估值还是比较合理的话，经过短暂调整后，还会继续沿着经济复苏和盈利增长的速度上涨。反过来的情况是，如果美国经济在明年上半年刺激政策逐步到期后，最终消费还是不能跟上，在下半年可能迫使美国政府会继续执行宽松的货币政策和积极的财政政策。那么，中国政府可能届时也要一起再次释放流动性和刺激政策，股市反而可能会加速上涨。

第二，国内的资产市场，尤其是房地产市场。如果资产价格上涨过快，可能会影响中央政府继续刺激内需和调整经济结构的决心和条件。从最新的政策种种迹象表明政府正在寻求更多促进消费的方法，希望刺激涉及面广、就业人口多、有利于拉动更多消费的行业。理性地看，房地产还是会继续发挥刺激内需的重要作用。但如果地产价格上涨过快显然会打击中央政府继续刺激内需和调整经济结构的决心和条件。好在，现在除了几个一线城市，我们并没有在全国范围内发现地产价格大幅上扬的情况。

§5 投资组合报告

5.1 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	5,986,643,279.06	90.69
	其中：股票	5,986,643,279.06	90.69
2	固定收益投资	365,935,000.00	5.54
	其中：债券	365,935,000.00	5.54
	资产支持证券	–	–
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	227,414,474.94	3.45
6	其他资产	20,918,938.70	0.32
7	合计	6,600,911,692.70	100.00

5.2 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	393,681,800.00	5.99
C	制造业	2,283,887,695.55	34.74
C0	食品、饮料	259,563,528.02	3.95
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	221,333,237.04	3.37
C5	电子	46,584,693.87	0.71
C6	金属、非金属	590,481,770.60	8.98
C7	机械、设备、仪表	880,728,014.93	13.40
C8	医药、生物制品	285,196,451.09	4.34
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	69,208,112.97	1.05
E	建筑业	47,625,700.08	0.72
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	287,362,875.55	4.37
H	批发和零售贸易	287,023,121.68	4.37
I	金融、保险业	1,446,348,537.79	22.00
J	房地产业	558,844,463.57	8.50
K	社会服务业	293,780,000.00	4.47
L	传播与文化产业	56,098,559.86	0.85
M	综合类	262,782,412.01	4.00
	合计	5,986,643,279.06	91.07

5.3 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	601166	兴业银行	8,705,000	294,141,950.00	4.47
2	000069	华侨城 A	15,880,000	293,780,000.00	4.47
3	601318	中国平安	5,700,000	288,990,000.00	4.40
4	600036	招商银行	18,690,000	276,238,200.00	4.20
5	000002	万科 A	24,199,946	252,163,437.32	3.84
6	600019	宝钢股份	33,299,894	215,117,315.24	3.27
7	600690	青岛海尔	13,580,000	211,712,200.00	3.22
8	000527	美的电器	12,100,000	209,330,000.00	3.18
9	601998	中信银行	37,209,939	209,119,857.18	3.18
10	601088	中国神华	6,800,000	206,448,000.00	3.14

5.4 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	365,935,000.00	5.57
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	–	–
7	其他	–	–
8	合计	365,935,000.00	5.57

5.5 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	0901047	09央行票据 47	1,000,000	99,670,000.00	1.52
2	0901037	09央行票据 37	800,000	79,736,000.00	1.21
3	0801112	08央行票据 112	500,000	48,260,000.00	0.73
4	0701007	07央行票据 07	400,000	40,200,000.00	0.61
5	0801114	08央行票据 114	400,000	38,696,000.00	0.59

5.6 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

本基金本报告期期末未持有资产支持证券。

5.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,321,525.07
2	应收证券清算款	7,719,746.65
3	应收股利	–
4	应收利息	5,337,357.76
5	应收申购款	3,528,309.22
6	其他应收款	12,000.00
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	20,918,938.70

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、交银施罗德基金管理有限公司期末持有本基金份额 23,334,139.18 份，占本基金期末总份额的 0.84%，报告期内未发生申购、赎回。

2、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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,917,539,266.58
报告期期间基金总申购份额	686,825,876.74
报告期期间基金总赎回份额	825,441,126.46
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	–
报告期期末基金份额总额	2,778,924,016.86

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德成长股票证券投资基金募集的文件；
2、《交银施罗德成长股票证券投资基金基金合同》；
3、《交银施罗德成长股票证券投资基金招募说明书》；
4、《交银施罗德成长股票证券投资基金托管协议》；
5、关于募集交银施罗德成长股票证券投资基金之法律意见书；
6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
8、报告期内交银施罗德成长股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

7.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。