（上接B10版）

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、基金的业绩比较标准

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2011年4月21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2011年1月1日至2011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	158,021,083.55	8.08
	其中：股票	158,021,083.55	8.08
2	固定收益投资	1,715,379,168.60	87.68
	其中：债券	1,715,379,168.60	87.68
	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	31,104,741.94	1.59
6	其他资产	51,850,131.03	2.65
7	合计	1,956,355,125.12	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	57,132,661.47	3.55
C0	食品、饮料	29,837,600.00	1.85
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	4,916,000.00	0.31
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	10,911,349.07	0.68
C8	医药、生物制品	11,467,712.40	0.71
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,426,000.00	0.40
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	5,557,858.80	0.35
I	金融、保险业	75,120,000.00	4.67
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	13,784,563.28	0.86
M	综合类	-	-
	合计	158,021,083.55	9.82

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	000783	长江证券	6,000,000	75,120,000.00	4.67
2	300146	汤臣倍健	260,000	29,837,600.00	1.85
3	601098	中南传媒	1,239,619	13,784,563.28	0.86
4	300142	沃森生物	108,084	11,467,712.40	0.71
5	600795	国电电力	2,100,000	6,426,000.00	0.40
6	601890	亚星锚链	280,689	5,386,421.91	0.33
7	300139	福星晓程	80,000	4,916,000.00	0.31
8	601777	力帆股份	347,931	4,300,427.16	0.27
9	601933	永辉超市	108,825	3,047,100.00	0.19
10	600998	九州通	178,068	2,510,758.80	0.16

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	169,012,000.00	10.51
3	金融债券	108,438,000.00	6.74
	其中：政策性金融债	98,320,000.00	6.11
4	企业债券	874,337,400.00	54.35
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	563,591,768.60	35.03
7	其他	-	-
8	合计	1,715,379,168.60	106.62

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	113002	工行转债	1,120,000	134,131,200.00	8.34
2	113001	中行转债	1,070,000	114,554,200.00	7.12
3	110015	石化转债	928,000	100,242,560.00	6.23
4	0801047	08央行票据47	1,000,000	100,160,000.00	6.23
5	100227	10国开27	1,000,000	98,320,000.00	6.11

6、本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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	720,509.07
2	应收证券清算款	19,995,092.89
3	应收股利	-
4	应收利息	30,903,810.54
5	应收申购款	230,718.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,850,131.03

（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	113002	工行转债	134,131,200.00	8.34
2	113001	中行转债	114,554,200.00	7.12
3	110003	新钢转债	79,080,021.60	4.92
4	110009	双良转债	54,981,977.40	3.42
5	110007	博汇转债	42,355,840.00	2.63
6	128233	塔牌转债	8,590,740.00	0.53
7	110078	澄星转债	5,867,000.00	0.36
8	125731	美丰转债	4,295,270.05	0.27

（5）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。（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2011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	-1.41%	0.41%	-1.00%	0.09%	-0.41%	0.32%
	2010年度	5.57%	0.35%	0.51%	0.10%	5.06%	0.25%
	2009年度	6.97%	0.43%	-3.45%	0.11%	10.42%	0.32%
	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	25.86%	0.35%	5.53%	0.18%	20.33%	0.17%
C类	过去三个月	-1.51%	0.41%	-1.00%	0.09%	-0.51%	0.32%
	2010年度	5.11%	0.35%	0.51%	0.10%	4.60%	0.25%
	2009年度	6.50%	0.43%	-3.45%	0.11%	9.95%	0.32%
	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	24.20%	0.35%	5.53%	0.18%	18.67%	0.17%

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

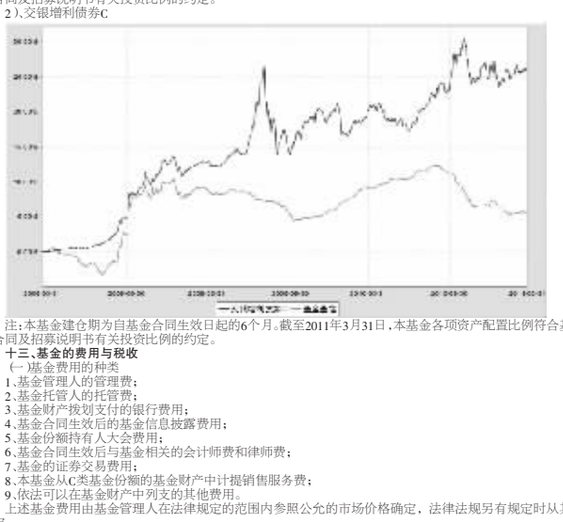
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2008年3月31日至2011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2011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2011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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经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，支付日期顺延。

②）基金托管人的托管费

在通常情况下，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×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经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托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

③）除管理费和托管费之外的基金费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

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

[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

[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：某投资人赎回本基金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：投资人赎回本基金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

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）转入基时，从无申购费用的交银货币和交银增利C类基金份额或申购费用低的基金向申购费用高的基金转换，收取申购补差费用；从申购费用高的基金向申购费用低的基金或无申购费用的交银货币和交银增利C类基金份额转换，不收取申购补差费用。申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费率差额进行补差。为更好服务投资人，对通过本公司e网行进行基金转换业务的个人投资者给予转换费率优惠，优惠费率只适用于申购补差费用，赎回费用无优惠。

3）转出基金时，转出交银货币和交银增利C类基金份额不收取赎回费用；转出交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银增利A类基金份额和交银保本收取赎回费用，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。

4）交银货币与交银增利C类基金份额之间相互转换，赎回费用为0，申购补差费用为0，投资人不需支付转换费用。

5）前端收费模式下的基金转换费率：

①交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理和交银主题之间的转换及由上述基金转入交银货币和交银增利A类、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：

转出基金	转入基金	持有时间	转换费率（即转出基金的赎回费率）
前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题	交银货币、交银增利A类、C类基金份额	1年以下（含1年）	0.5%
	前端收费模式下交银成长、交银稳健、交银精选、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题	1年至2年（含2年）	0.2%
		2年以上	0

②交银货币、交银增利C类基金份额转入前端收费模式下的交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理和交银主题，赎回费用为0，投资人需支付转入基金的申购费用，具体如下：

转出基金	转入基金	转换金额	转换费率（即转入基金的申购费率）
交银货币、交银增利C类基金份额	前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题	50万元以下	1.5%
		50万元（含）至100万元	1.2%
		100万元（含）至200万元	0.8%
		200万元（含）至500万元	0.5%
		500万元以上（含500万）	每笔交易1000元

③交银货币转入交银增利A类基金份额，赎回费用为0，投资人需支付转入基金的申购费用，具体如下：

转出基金	转入基金	转换金额	转换费率（即转入基金的申购费率）
交银货币	交银增利A类基金份额	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）	每笔交易1000元

④交银增利A类基金份额转入交银货币，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：

转出基金	转入基金	持有时间	转换费率（即转出基金的赎回费率）
交银增利A类基金份额	交银货币	1年（含1）以下	0.1%
		1年至2年（含）	0.05%
		2年以上	0

⑤交银保本转换出到前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银货币、交银增利A类和C类基金份额，投资人需支付转出基金的赎回费用，具体如下：

转出基金	转入基金	持有时间	转换费率（即转出基金的赎回费率）
交银保本	前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题	1年以内（含）	2.0%
		1年至2年（含）	1.6%
		2年至3年	1.2%
		持有到保本周期到期日及以上	0.0%
	交银货币、交银增利A类、C类基金份额		

6）通过本公司e网行办理基金转换业务的个人投资者可享受转换费率优惠，具体转换费率优惠规则如下：

①通过本公司e网行由交银货币和交银增利C类基金份额转入前端收费模式下的交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理和交银主题，享受转换费率优惠如下：

转出基金	转入基金	转换金额	日常转换费率（即转入基金的申购费率）	优惠后转换费率（即优惠后转入基金的申购费率）
交银货币、交银增利C类基金份额	前端收费模式下：交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题	50万元以下	1.5%	0.6%
		50万元（含）至100万元	1.2%	0.6%
		100万元（含）至200万元	0.8%	0.6%

单笔转换金额超过200万元（含）的不享受转换费率优惠，按照日常转换费率执行。

②通过本公司e网行由交银货币转入交银增利A类基金份额，享受转换费率优惠如下：

转出基金	转入基金	转换金额	日常转换费率（即转入基金的申购费率）	优惠后转换费率（即优惠后转入基金的申购费率）
交银货币	交银增利A类基金份额	50万元以下	0.8%	0.6%

单笔转换金额超过50万元（含）的不享受转换费率优惠，按照日常转换费率执行。

网上直销基金转换费率优惠业务仅针对旗下交银货币和交银增利C类基金份额向前端收费模式下的交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理和交银主题的转换，以及由交银货币向交银增利A类基金份额（即前端收费模式）的转换。

7）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。

（7）基金转换份额的计算公式

A=（B×C×（1-D））÷F

其中：

A为转入的基金份额；

B为转出的基金份额；

C为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D为对应的转换费率；

E为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

F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F为0）。

转入基金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：（前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理和交银主题之间进行转换）某投资者持有交银精选前端收费模式的基金份额100,000份，持有期一年半，转换申请当日交银精选的基金份额净值为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份交银精选前端基金份额转换为交银稳健前端基金份额，则转入交银稳健的基金份额为：

转入份额=［100,000×1.2500×（1-0.2%）］/2.2700=54,955.95份

例二：（前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理和交银主题转换为交银货币或交银增利A类、C类基金份额）某投资者持有交银精选前端收费模式的基金份额100,000份，持有期一年半，转换申请当日交银精选的基金份额净值为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份交银精选前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：

转入份额=［100,000×1.2500×（1-0.2%）］/1.00=124,750.00份

例三：（交银货币或交银增利C类基金份额转换为前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理和交银主题）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，则转入的交银精选基金份额为：

转入份额=［100,000×1.2500×（1-1.5%）］/2.2700=54,240.09份

例四：（交银货币转换为交银增利A类基金份额）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，则转入的交银增利A类基金份额为：

转入份额=［100,000×1.00×（1-0.8%）+61.52］/1.2700=78,158.68份

例五：（交银增利A类基金份额转换为交银货币）某投资者持有交银增利A类基金份额 100,000份，持有期一年半，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份交银增利A类基金份额转换为交银货币基金份额，则转入交银货币的基金份额为：

转入份额=［100,000×1.2700×（1-0.05%）］/1. 00=126,936.5份

例六：（交银保本转换出到前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银货币、交银增利A类和C类基金份额）某投资者持有交银保本的基金份额100,000份，持有期一年半，转换申请当日交银保本的基金份额净值为1.150元，交银先锋的基金份额净值为1.2700元。若该投资者将100,000份交银保本基金份额转换为交银先锋的基金份额，则转入的交银先锋的基金份额为：

转入份额=［100,000×1.150×（1-1.6%）］/1.2700=89102.36份

⑧）网上交易的有关费率

本基金管理人已开通中国农业银行金穗借记卡（以下简称“农行卡”）、交通银行太平洋借记卡（以下简称“交行卡”）、中国建设银行龙卡借记卡（以下简称“建行卡”）、上海浦东发展银行借记卡（以下简称“浦发卡”）、兴业银行借记卡（以下简称“兴业卡”）、中信银行借记卡（以下简称“中信卡”）和中国民生银行借记卡（以下简称“民生卡”）的基金网上直销业务，持有上述借记卡的个人投资者可以直接通过本公司网站办理开户手续，并通过“交银施罗德基金管理有限公司e网行基金网上直销系统”（以下简称“e网行”）办理本基金A类和C类基金份额的申购、赎回和转换等业务，已认申购本基金B类基金份额的个人投资者，通过转托管转入网上直销账户的B类基金份额只能办理赎回业务。通过e网行办理本基金A类基金份额申购业务的个人投资者将享受前端申购费率的优惠，通过e网行办理本基金A类基金份额转换入和C类基金份额转出业务的个人投资者将享受转换费中相应前端申购补差费率的优惠，其他费率标准不变。通过e网行申购本基金时所适用的具体优惠费率请参见公司网站列示的e网行直销申购费率表或相关公告。

个人投资者通过e网行办理本基金A类基金份额的申购业务最高限额为单笔申购100万元（不含100万元），办理本基金C类基金份额的申购业务不设单笔最高限额。个人投资者通过e网行申购本基金时还须受相关银行卡日交易金额限制。各银行卡日交易金额限制如下：

①通过农行卡、交行卡或兴业卡进行网上申购无日交易金额的限制；

②通过建行卡进行网上申购每日累计认（申）购本公司旗下所有基金的最高限额为500万元（含500万元）；

③通过浦发卡或中信卡进行网上申购每日累计认（申）购本公司旗下所有基金的最高限额为100万元（含100万元）；

④通过民生卡进行网上申购每日累计认（申）购本公司旗下所有基金的最高限额为5000万元（含5000万元）。

持有农行卡或民生卡的个人投资者可以通过本基金管理人e网行办理网上直销定期定额投资业务并享受A类基金份额申购费率优惠，统一申购优惠费率为申购金额的0.6%。

投资人通过本基金管理人e网行定期定额申购本基金的单笔申购金额最低限额为人民币200元（含200元），不受网上直销日常申购的最低数额限制。

本基金管理人于2009年11月11日公告，自2009年11月11日起对通过e网行办理本公司旗下部分基金转换业务的个人投资者给予转换费率优惠。详情请参阅本基金管理人2009年11月11日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于开展网上直销基金转换费率优惠活动的公告》。

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。

⑨）基金管理人可以根据法律法规及基金合同的规定调整申购费率和赎回费率，最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率开始实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（三）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效前所发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用，不得从基金财产中列支。

（四）基金管理费和托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况协商调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率或改变收费模式。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率或在不提高整体费率水平的情况下改变收费模式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

基金管理人必须最迟于新的费率或收费模式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

总体更新

本次更新招募说明书更新了“重要提示”、“基金管理人”、“基金托管人”、“相关服务机构”、“基金份额的申购与赎回”、“基金的转换”、“基金的投资”、“基金的业绩”以及“其他应披露事项”等部分的内容。

“重要提示”部分

更新了本招募说明书所载相关内容截止日。

“三、基金管理人”部分

1、“（一）基金管理人概况”

更新了相关信息。

2、“（二）主要成员情况”

“1、基金管理人董事会成员”

更新董事会成员信息。

“2、基金管理人监事会成员”

更新监事会成员信息。

“3、公司高管人员”

更新高管人员信息。

“4、本基金基金经理”

更新本基金基金经理从业经验年限以及基金管理经历。

“5、投资决策委员会成员”

更新投资决策委员会成员名单以及相关成员职务信息。

“四、基金托管人”部分

更新了基金托管人基本情况、托管业务经营情况等内容。

“五、相关服务机构”部分

1、“（一）基金份额销售机构”

“2、代销机构”

更新代销机构的相关信息。

2、“（二）登记结算机构”

更新登记结算机构相关信息。

3、“（四）审计基金财产的会计师事务所”

更新审计基金财产的会计师事务所的住所地址。

“八、基金份额的申购与赎回”部分

1、“（一）申购和赎回的场所”

“3、办理本基金代销业务的各代销机构的代销网点”：

更新代销机构的相关信息。

2、“（六）基金的申购费和赎回费”

“3、网上交易的有关费率”

完善相关表述。

3、“（十三）定期定额投资计划”

增加及更新了本基金开通定期定额投资计划的代销机构的相关信息。

“九、基金的转换”部分

“（三）转换业务办理地点”

增加及更新了本基金与公司旗下其他基金开通转换业务的代销机构的相关信息。

“十、基金的投资”部分

更新“十三、基金投资组合报告”。数据截止到2011年3月31日。

“十一、基金的业绩”部分

更新基金的业绩，数据截止到2011年3月31日。

“十三、其他应披露事项”部分

更新了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

二〇一一年五月十四日

诺安保本混合型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期：2011年5月14日

§1 公告基本信息

基金名称	诺安保本混合型证券投资基金
基金简称	诺安保本混合
基金主代码	320015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月13日
基金管理人名称	诺安基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《诺安保本混合型证券投资基金基金合同》、《诺安保本混合型证券投资基金招募说明书》

§2 基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号	中国证监会证监许可【2011】357号	
基金募集期间	自2011年4月8日起至2011年5月10日止	
验资机构名称	利安达会计师事务所有限责任公司	
募集资金划入基金托管专户的日期	2011年5月12日	
募集有效认购总户数（单位：户）		18799
募集期间净认购金额（单位：人民币元）		2,700,176,245.44
认购资金在募集期间产生的利息（单位：人民币元）		951,519.52
募集份额（单位：份）	有效认购份额	2,700,176,245.44
	利息结转的份额	951,519.52
	合计	2,701,127,764.96
其中：募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额（单位：份）	204,694.40
	占基金总份额比例	0.0076%
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的