交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金（更新）招募说明书摘要

（2013年第2号）

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一三年七月

【重要提示】

交银施罗德保本混合型证券投资基金经2008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[2008]1285号文核准募集。《交银施罗德保本混合型证券投资基金基金合同》于2009年1月21日正式生效。

交银施罗德保本混合型证券投资基金（以下使用全称或其简称“交银保本”）的保本周期期限为三年，自基金合同生效日起至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日，即于2012年1月30日保本周期到期，由于不符合保本基金存续条件，按照《交银施罗德保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，交银保本保本周期到期后转型为非保本的混合型基金，名称相应变更为“交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金”。

本基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的有关规定，并依据《交银施罗德保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，在不损害基金份额持有人利益的前提下，就变更后的“交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金”（以下简称“本基金”）修改其《基金合同》、《托管协议》及《招募说明书》，并报经中国证监会备案。

基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本招募说明书已报经中国证监会备案，但并不表明中国证监会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、谨慎勤勉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。投资者在投资本基金前，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。投资者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，由于基金投资者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。本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的较高风险品种，风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

投资有风险，投资者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》。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新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2013年7月21日，有关财务数据和净值表现截止日为2013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：钱文挥

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%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的合法权益。公司董事会下设合规审核及风险管理委员会、提名与薪酬委员会两个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由四位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司总体经营管理由总经理负责，下设风险控制委员会和投资决策委员会两个专业委员会，其中投资决策委员会包括公募基金（除QDII）投资决策委员会、QDII投资决策委员会和专户投资决策委员会。公司设督察长，监督检查基金和公司运作的合法合规及公司内部风险控制情况。投资研究条线下设权益部、固定收益部、专户投资部、研究部、量化投资部、跨境投资部、投资运营部。中央交易室隶属总经理直接管理。市场条线下设产品开发部、营销策划部、零售理财部、营销管理部、机构理财部、上海营销中心、北京分公司、广州分公司、西部营销中心。营运条线下设财务部、基金运营部与信息技术部。综合管理条线下设人力资源部和行政部。监察稽核条线下设监察稽核部、风险管理部、法务部，由督察长协同总经理直接管理。此外，根据业务需要，增设了战略发展部、董事会监事会办公室。本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。投资管理流程中，基金经理、研究员、交易员在明确权责的基础上密切合作，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。

截止到2013年6月30日，公司已经发行并管理了28只基金，包括1只货币市场基金、7只债券型基金（其中2只为短期理财债券基金）、2只保本混合型基金、3只混合型基金、15只股票型基金（其中2只为QDII基金，1只为普通指数型基金，2只为交易型开放式基金（ETF），2只为ETF联接基金）。

截止到2013年6月30日，公司有员工214人，其中52%的员工具有硕士以上学历。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度。

（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。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。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、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，现任交通银行投资银行部总经理。

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

谢丹阳先生，独立董事，博士学历。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，现任香港科技大学教授、瑞安经管中心主任。

袁志刚先生，独立董事，博士学历。历任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任，现任复旦大学经济学院院长。

周林先生，独立董事，博士学历。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，现任上海交通大学安泰经济与管理学院院长、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。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。现任交银施罗德基金管理有限公司总经理助理。

陈超女士，监事，硕士学历。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，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。

张科兵先生，监事，学士学历。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，现任交银施罗德基金管理有限公司研究总监。

3、公司高管人员

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。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

张迎军先生，基金经理，经济学硕士。13年证券从业经验。2000年7月至2003年3月任职于申银万国证券研究所，担任市场研究部、策略研究部研究员；2003年4月至2006年11月任职于中国太平洋保险（集团）股份有限公司，担任资金运用管理中心投资经理，2006年12月至2008年5月任职于太平洋资产管理有限公司，担任组合管理部组合经理。2008年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任固定收益部副总经理，现任权益部副总经理。2009年1月21日至2012年2月2日担任本基金转型前的交银施罗德保本混合型证券投资基金基金经理，2012年2月3日起担任本基金基金经理至今，并于2011年5月3日起兼任交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金经理至今。

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（权益部总经理、基金经理）

胡军华（固定收益部总经理、基金经理）

张科兵（研究总监、基金经理）

上述人员之间无近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币349,018,545,827元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

（二）主要人员情况

截至2013年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工163人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2013年6月，中国工商银行共托管证券投资基金314只，其中封闭式3只，开放式311只。自2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的40项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009、2010、2011年五次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70（审计标准第70号）审阅后，2012年中国工商银行资产托管部第六次通过ISAE3402（原SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化的目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（五）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

根据《基金法》、《基金合同》，托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、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基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自《基金合同》生效之日起开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》，托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

本基金直销机构为本公司以及本公司的网上直销交易平台。

机构名称：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：上海市浦东新区世纪大道201号渣打银行大厦10楼

法定代表人：钱文挥

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.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com

个人投资者可以通过本公司网上直销交易平台办理开户、本基金的申购、赎回及转换等业务，具体交易细则请参阅本公司网站。网上直销交易平台网址：www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com

2、代销机构

（1）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
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

（2）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

（3）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

（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）中国邮政储蓄银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城区金融大街3号
法定代表人：李国华
传真：（010）68858117
联系人：陈春林
客户服务电话：95580
网址：www.psbc.com

（6）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

（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：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

（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：范一飞
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）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：田国立
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

（10）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）57092615
传真：（010）57092611
联系人：董云巍
客户服务电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn

（11）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

（12）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）22169999
传真：（021）22169134
联系人：刘晨
客户服务电话：10108998
网址：www.ebscn.com

（13）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：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层
法定代表人：万建华
电话：（021）38676161
传真：（021）38670161
联系人：芮敏棋
客户服务电话：95521，400-8888-666
网址：www.gtja.com

（14）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

（15）海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
电话：（021）23219000
传真：（021）23219100
联系人：李笑鸣
客户服务电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话
网址：www.htsec.com

（16）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

（17）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

（18）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

（19）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

（20）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

（21）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

（22）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：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心11楼
法定代表人：林俊波
电话：（021）68634518
传真：（021）68865680
联系人：钟康莺
客户服务电话：400-888-1551
网址：www.xcsc.com

（23）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

（24）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）83290979
传真：（025）51863323
联系人：万鸣
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

（25）中信证券（浙江）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）85776115
传真：（0571）85783771
联系人：俞会亮
客户服务电话：（0571）96598
网址：www.96598.com.cn

（26）中银国际证券有限责任公司
住所：上海市银城中路200号39层
办公地址：中国上海浦东银城中路200号中银大厦39-40层
法定代表人：许刚
联系人：李丹
客户服务电话：400-620-8888
网址：www.bocichina.com

（27）中信万通证券有限责任公司
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

（28）恒泰证券股份有限公司
住所：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人：庞介民
电话：（0471）4979037
传真：（0471）4961259
联系人：王旭华
客户服务电话：（0471）4960762，（021）68405273
网址：www.cnht.com.cn

（29）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16-26楼
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼
法定代表人：何如
电话：（0755）82130833
传真：（0755）82133952
联系人：齐晓燕
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

（30）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

（31）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：4006000686，（0431）85096733
网址：www.nesc.cn

（32）中航证券有限公司
住所：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦41楼
办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦41楼
法定代表人：杜航
电话：（0791）86768681
传真：（0791）86770178
联系人：戴蕾
客户服务电话：400-8866-567
网址：www.avicsec.com

（33）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.essence.com.cn

（34）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

（35）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

（36）华福证券有限责任公司
住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：黄金琳
电话：（0591）87383623
传真：（0591）87383610
客户服务电话：（0591）96326
网址：www.hfzq.com.cn

（37）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）66045608
传真：（010）66045527
联系人：林爽
客户服务电话：（010）66045678
网址：http://www.txsec.com，www.jjm.com.cn

（38）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

（39）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

（40）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）58788678
传真：（021）58787698
联系人：敖玲
客户服务电话：400-089-1289
网址：www.erichfund.com

（41）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
电话：（021）68596916
联系人：薛年
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

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

（二）注册登记机构
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：金颖
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：梁丽金、刘佳

（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
法定代表人：杨绍信
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：魏佳亮
经办注册会计师：汪棣、屈斯洁

四、基金的名称

本基金名称：交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金

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

根据宏观经济周期和市场环境的变化，自上而下灵活配置资产，积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力求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，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。

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：股票资产占基金资产的30%-80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的20%-70%，其中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%。在基金实际管理过程中，管理人将根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，在上述投资组合比例范围内，适时调整基金资产在股票、债券及货币市场工具间的配置比例。

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周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整投资组合比例，自上而下灵活配置资产；通过把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挖掘预期具有良好增长前景的优势行业，精选个股，以谋求超额收益。

1、资产配置

本基金将采用“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实现大类资产的灵活配置。具体而言，首先利用经济周期理论，对宏观经济的经济周期进行预测，在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在各类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，以规避或分散市场风险，提高基金收益率。同时，本基金将充分借鉴施罗德集团公司在配置型基金方面成功的投资经验。具体操作中，本基金管理人采用经济周期理论下的资产配置模型，通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析，对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测，然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。

2、优势行业选择

国民经济快速增长的背后蕴涵了不同行业对GDP增长贡献率的差异。而不同行业受宏观经济周期、行业自身生命周期以及相关结构性因素的影响在不同时期表现往往具有明显差异。

本基金管理人通过在全球经济的框架下建立交银施罗德优势行业评估体系，采用多因素的定性与定量相结合的分析和预测方法，确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机，据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业，把握行业景气轮换带来的投资机会。

具体操作中，我们对行业的挑选重点分为两个部分，即行业平均增长率预测和行业综合评价。首先考察各行业历史收入和利润增长表现，对未来行业收入增长率和行业平均利润增长率进行预测；对根据预测结果计算的增长率低于GDP增长率的行业进行剔除。然后根据交银施罗德优势行业评估体系，对行业的综合表现和增长空间进行评估和排序，挑选出未来一段时间内最具增长前景的行业。具体评估将从宏观经济环境（重点包括宏观经济政策、产业政策对相关行业发展的影响）、行业景气度分析和预测（关注上下游行业对本行业景气度影响、密切追踪各行业景气度指标）、行业财务状况（行业盈利能力、行业经营效率）和行业竞争力综合表现四个方面入手，采用定性分析结合定量分析的方法对行业的未来的增长前景进行综合评价。

最后，在完成对行业增长预测和行业综合评价基础上，通过市场及各个行业的相对和绝对估值水平PE、PB等数据的横向、纵向分析，进行估值比较，并跟踪各行业的资金流向、机构持仓特征等判断行业吸引力，动态把握行业板块轮换蕴涵的投资机会。

3、股票选择

本基金综合运用施罗德集团的股票研究分析方法和其它投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合，前述优势行业中股票优先入选。具体分以下两个层次进行股票挑选：

（1）品质筛选

筛选出在公司治理、财务及管理品质上符合基本品质要求的上市公司，构建备选股票池，主要筛选指标包括：盈利能力指标（如P/E、P/Cash Flow、P/FCF、P/S、P/EBIT等）、经营效率指标（如ROE、ROA、Return on operating assets等）和财务状况指标（如D/A、流动比率等）。

（2）多元化价值评估

本基金在前述优势行业选择体系的基础上，根据下述标准挑选出其中具有投资潜力的上市公司构建核心股票池：

①公司治理结构良好，管理规范，信息透明；

②主营业务鲜明，盈利能力强，收入和利润稳定增长；

③公司具有质量优良的成长性，通过对控制企业盈利增长质量的指标（如ROIC-WACC、EVA等）进行评估，挑选EVA不断增长或改善的优质公司；

④公司财务状况良好，具备一定的规模优势和较好的抗风险能力；

⑤公司在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相当的核心竞争优势，有良好的市场知名度和较好的品牌效应，处于行业龙头地位。

对上述核心股票池中的重点上市公司进行内在价值的评估和成长性跟踪研究，在明确的价值评估基础上选择定价相对合理且成长性可持续的投资标的。

4、债券投资策略

在债券投资方面，本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本基金的债券投资采取主动的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。

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作出判断，运用数量化工具，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略和换券等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。

5、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

6、资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、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、其他衍生工具投资策略

本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向，一旦有新的产品推出市场，将在届时相应法律法规的框架内，制订符合本基金投资目标的投资策略，同时结合对衍生工具的研究，在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下，谨慎进行投资。本基金将按照相关法律法规通过利用股票指数期货及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金投资于股票指数期货主要用于避险交易及套利交易。

九、基金的业绩比较标准

本基金的整体业绩比较基准采用：

60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率

本基金股票投资部分的业绩比较基准是沪深300指数，债券投资部分的业绩比较基准是中信标普全债指数。

沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成。该指数样本对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性，投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取。同时该指数引进国际指数编制和管理的经验，编制方法清晰透明，具有独立性和良好的市场流动性；与市场整体表现具有较高的相关度。沪深300指数是目前衡量本基金股票投资业绩的理想基准。同时，根据本基金的目标资产配置比例来分配权重，本基金的业绩比较基准中加入了中信标普全债指数并按照本基金的目标资产配置比例来安排。

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调整业绩比较基准，并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的较高风险品种，风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

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。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于2013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2013年4月1日至2013年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	196,702,268.52	60.65
	其中：股票	196,702,268.52	60.65
2	固定收益投资	108,359,482.15	33.41
	其中：债券	108,359,482.15	33.41
	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	3,544,900.60	1.09
6	其他各项资产	15,720,354.89	4.85
7	合计	324,327,006.16	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	7,954,400.00	2.82
B	采矿业	-	-
C	制造业	103,778,813.73	36.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,198,328.58	5.03
F	批发和零售业	2,955,000.00	1.05
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,328,016.91	5.07
J	金融业	13,415,789.30	4.75
K	房地产业	23,179,500.00	8.21
L	租赁和商务服务业	6,864,000.00	2.43
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,028,420.00	3.55
S	综合	-	-
	合计	196,702,268.52	69.64

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	601628	中国人寿	979,970	13,415,789.30	4.75
2	600519	贵州茅台	67,902	13,062,307.74	4.62
3	300024	机器人	350,000	13,002,500.00	4.60
4	600406	国电南瑞	846,937	12,644,769.41	4.48
5	000423	东阿阿胶	313,587	12,129,545.16	4.29
6	002106	莱宝高科	626,093	9,610,527.55	3.40
7	600208	新湖中宝	3,050,000	9,424,500.00	3.34
8	002081	金螳螂	318,796	9,076,122.12	3.21
9	002304	洋河股份	150,688	8,182,358.40	2.90
10	002415	海康威视	230,000	8,128,200.00	2.88

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	19,932,000.00	7.06
	其中：政策性金融债	19,932,000.00	7.06
4	企业债券	76,730,242.15	27.17
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,697,240.00	4.14
8	其他	-	-
9	合计	108,359,482.15	38.36

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	122033	09富力债	303,440	30,966,052.00	10.96
2	098016	09南钢联债	300,000	30,396,000.00	10.76
3	120238	12国开38	200,000	19,932,000.00	7.06
4	113003	重工转债	107,000	11,697,240.00	4.14
5	112015	09泛海债	82,373	8,319,673.00	2.95

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。

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。

8、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。

9、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除贵州茅台（证券代码：600519）外，未受到公开谴责和处罚。

报告期内本基金投资的前十名证券之一贵州茅台（证券代码：600519）于2013年2月23日公告，公司于2013年2月22日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》。为此，根据相关规定给予处罚，限贵州茅台酒销售有限公司自收到该决定书之日起十五日内将罚款二亿四千七百万元人民币上交国库。公司已于2013年2月23日披露处罚公告，并于规定时间内按照处罚决定上交罚款。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资特别是重仓股的投资有严格的投资决策流程控制。本基金在对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上，严格执行公司股票池审核流程进入公司核心股票池。在对该证券的持有过程中公司研究员密切关注上市公司动向。在上述被行政处罚事件发生时及时分析其对投资决策的影响，经过分析认为此事件对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，所以不影响对该公司基本面和公司治理的投资判断。

（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	184,261.89
2	应收证券清算款	12,992,140.81
3	应收股利	-
4	应收利息	2,533,111.83
5	应收申购款	10,840.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,720,354.89

（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	11,697,240.00	4.14

（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	002106	莱宝高科	3,070,000.00	1.09	非公开发行

（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2013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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

（1）交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.28%	1.22%	-6.76%	0.88%	7.04%	0.34%
2013年度上半年	3.59%	1.14%	-6.63%	0.91%	10.22%	0.23%
基金转型日2012年2月3日-2012年12月31日	-2.41%	0.76%	2.71%	0.72%	-5.12%	0.04%

注：交银施罗德保本混合型证券投资基金从2012年2月3日起正式转型为交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金，本表列示的是基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率。

（2）交银施罗德保本混合型证券投资基金

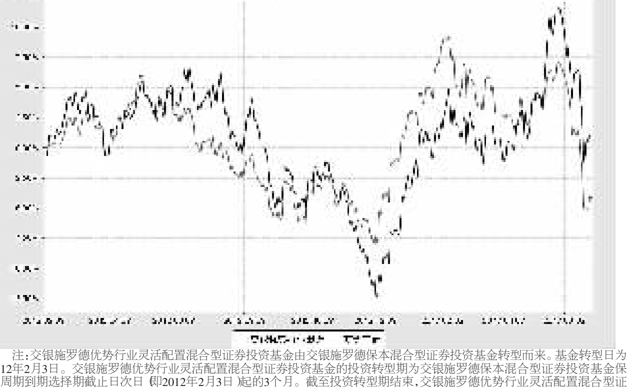
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012年1月1日-2012年2月2日	0.37%	0.04%	0.41%	0.03%	-0.04%	0.01%
2011年度	-0.74%	0.28%	4.54%	0.01%	-5.28%	0.27%
2010年度	4.33%	0.38%	3.38%	0.01%	0.95%	0.37%
2009年度(2009年1月21日-2009年12月31日)	7.50%	0.25%	3.19%	0.01%	4.31%	0.24%

注：交银施罗德保本混合型证券投资基金从2012年2月3日起正式转型为交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金，本表列示的是基金转型前的基金净值表现，转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款收益率。

2、基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

（1）自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

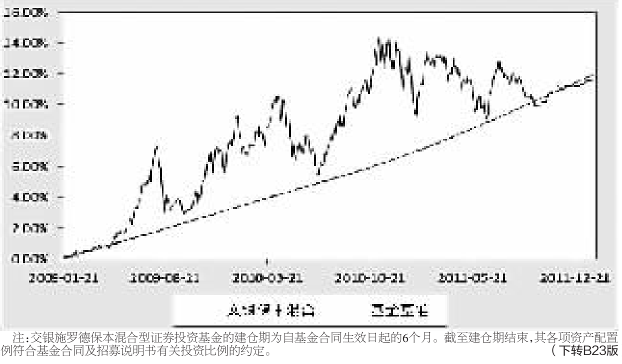
交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2012年2月3日至2013年6月30日）



注：交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金由交银施罗德保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日为2012年2月3日。交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金的投资转型期为交银施罗德保本混合型证券投资基金保本周期到期选择期截止日次日（即2012年2月3日）起的3个月。截至投资转型期结束，交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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

交银施罗德保本混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2009年1月21日至2012年2月2日）



注：交银施罗德保本混合型证券投资基金的建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，其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。

（下转B23版）

交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金在交通银行开通货币基金实时提现业务的公告

为了满足投资者理财资金的快速周转需求，提升资金使用效率，交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）合作自2013年9月5日起推出交银施罗德货币市场证券投资基金（以下简称“交银货币”或“货币基金”）的货币基金实时提现业务，现将有关事项具体公告如下：

一、货币基金实时提现业务

“货币基金实时提现业务”是本公司为持有交通银行代销的交银货币份额的持有人提供的增值服务，具体指：就投资者通过交通银行开立的基金交易账户持有的交银货币，当投资者急需资金时，可向交通银行申请货币基金实时提现业务，将其持有的交银货币基金份额质押给本公司（即过户到本公司开立的交银货币基金实时提现业务专用账户），通过交通银行验证后，本公司委托交通银行从本公司在交通银行开立的备付金账户中实时支付过户基金份额的净值扣除货币基金实时提现业务手续费后的提现资金至投资者货币基金关联的交通银行资金账户中。经过基金注册登记机构确认后，本公司办理所过户基金份额的赎回业务，赎回款用于归还本公司已经垫付的款项及支付相应手续费。

二、适用范围

本业务适用的基金范围为交银货币A级份额（基金代码：519588），服务对象为符合相关法律法规规定，在交通银行开立交易账户持有交银货币基金份额的个人投资者。如未来本公司调整货币基金实时提现业务的适用范围的，届时将另行公告。

三、业务规则

1、本公告所述“工作日”指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。

2、投资者通过交通银行柜台办理货币基金实时提现业务的申请时间为周一至周五的9:30-15:00（不含法定节假日）；通过交通银行网上银行、手机银行办理货币基金实时提现业务的申请时间为每个自然日（包括周一至周日）的0:00-24:00。

3、单个投资者T日15:00至T+1日15:00（T日、T+1日均指工作日）累计申请实时提现的金额上限为人民币伍万（50,000）元，并且单笔申请实时提现的金额上限为人民币伍万（50,000）元。本公司有权根据业务发展的需要，相应调整上述交易限额并予以公告。

4、当投资者持有的交银货币基金份额状态正常，相应的关联银行账户和基金账户状态正常，且其交易账户持有足够的交银货币基金份额余额时，方可提交货币基金实时提现申请。

5、本公司在交通银行开立的备付金账户T日15:00至T+1日15:00（T日、T+1日均指工作日）垫付的资金总额上限为人民币贰仟万（20,000,000）元，本公司有权根据业务发展的需要相应调整该上限。交通银行按照投资者提交货币基金实时提现业务的申请时间逐笔划拨资金给投资者，如备付金账户余额不足以支付实时提现申请金额，则投资者无法提交该笔货币基金实时提现业务申请。

6、实时提现资金一旦划入投资者账户，投资者将不能撤销相应的基金份额快速过户申请。

7、过户到本公司开立的交银货币基金实时提现业务专用账户的基金份额（以下简称“过户份额”）=（货币基金实时提现申请成功的金额+手续费）/1.00元。

8、投资者在工作日15:00前提交实时提现申请的，如基金注册登记机构成功确认，则从该工作日起（含该日），过户份额的基金收益归本公司；过户份额在交银货币上一收益结转日（不含该日）至该工作日的前一自然日产生的历史累计未结转收益归投资者所有，并于交银货币下一收益结转日结转为份额计入投资者交易账户。例如，投资者在周四（非法定节假日）10:00提交实时提现申请的，过户份额在周四当天及之后的基金收益归本公司，过户份额在交银货币上一收益结转日（不含该日）至周三当天产生的历史累计未结转收益归投资者。

9、投资者在工作日15:00后及非工作日提交实时提现申请的，如基金注册登记机构成功确认，则从下一工作日起（含该日），过户份额的基金收益归本公司；过户份额在交银货币上一收益结转日（不含该日）至下一工作日的前一自然日产生的历史累计未结转收益归投资者所有，并于交银货币下一收益结转日结转为份额计入投资者交易账户。例如，投资者在周五20:00提交实时提现申请的，过户份额在下周一（非法定节假日）当天及之后的基金收益归本公司，过户份额在交银货币上一收益结转日（不含该日）至周日当天产生的历史未结转收益归投资者。

10、投资者申请货币基金实时提现提交的交银货币基金份额将过户给本公司，如因投资者的原因，包括但不限于有权机关要求冻结、扣划、非交易过户、强制赎回货币基金份额等情形，导致投资者持有的货币基金份额无法及时过户给本公司或本公司无法及时赎回过户份额，或由于其他原因导致投资者不能及时归还本公司已经垫付的实时提现资金及支付手续费等情况，本公司将通过如下方式行使追偿上述款项的权利：

（1）本公司有权委托交通银行冻结投资者货币基金实时提现相应的交银货币基金份额。

（2）本公司有权对投资者所持有的本公司旗下基金份额（包括且不限于货币基金）进行相应的过户处理，相关过户费用（包括且不限于赎回费）由投资者承担，相关基金份额在过户后净值上涨的收益由本公司享有，净值下跌的损失亦由本公司承担，投资者不再享有相关收益或承担相关损失。

（3）本公司有权要求投资者在其提交货币基金实时提现业务申请所属的有效申请日起七个工作日内以现金方式清偿完毕本公司的垫付资金和手续费，逾期清偿的并按逾期支付款项万分之五的标准支付日违约金。

11、本公告所称的“质押”，是指投资者将其所持有的、与本公司为其垫付的资金及应收手续费对应的基金份额过户至本公司的货币基金实时提现业务专用账户，且本公司可以该等过户份额的赎回款优先清偿垫付款和收取手续费的安排。若该安排不符合质押的构成要件，则本公告所称的“质押”仅为该安排的称谓性表述，不影响该安排实质内容的有效性。

四、货币基金实时提现业务手续费

自2013年9月5日起至2014年12月31日止为货币基金实时提现业务的推广期，在此期间投资者使用货币基金实时提现业务将享受免除货币基金实时提现业务手续费的优惠措施。推广期届满后的货币基金实时提现业务手续费收取标准将另行公告。

五、重要提示

1、投资者通过交通银行办理交银货币实时提现业务的相关流程应遵循交通银行的有关规定，投资者申请货币基金实时提现业务前，请仔细阅读相关法律文件和业务规则。

2、本公司和交通银行可根据业务需要经协商一致对货币基金实时提现业务申请限额、业务规则和手续费等进行调整，并依据相关法律法规的规定进行公告。

3、本公告仅对在交通银行开通交银货币货币基金实时提现业务的有关事项予以说明，投资者欲了解交银货币的详细情况，请登录本公司网站（www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com）认真查阅相关基金合同和最新的招募说明书，或拨打本公司客户服务电话（400-700-5000，021-61055000）查询。

六、投资者可通过以下途径了解或咨询详情

1、交通银行股份有限公司
网址：www.bankcomm.com
客户服务电话：95559

2、交银施罗德基金管理有限公司
网址：www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com
客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），（021）61055000

风险提示：

1、在以下情况下，本公司可临时暂停货币基金实时提现业务，并视情况及时恢复该业务：

（1）第三方通讯故障；

（2）本公司或交通银行出现系统故障、系统升级或其他系统暂停服务情形；

（3）所有投资者当日实时提现总额超过本公司设定的限额。

2、如投资者关联银行资金账户已销户、卡号变更、账户状态不正常（挂失、冻结），或自然灾害，网络、通讯故障等不可抗力事件导致垫付款项无法按期向投资者划付的，交通银行及本公司不承担任何责任。

3、本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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司
二零一三年九月四日