交银施罗德阿尔法核心股票型证券投资基金（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：中国建设银行股份有限公司

二〇一三年八月

【重要提示】

交银施罗德阿尔法核心股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2012年3月2日中国证券监督管理委员会证监监许可【2012】274号文核准募集。本基金基金合同于2012年8月3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，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资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，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。本基金是一只股票型基金，属于基金中的高风险品种，本基金的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

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8月3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：2亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：陈超
电话：（021）61055050
传真：（021）61055034

交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准设立。公司股权结构如下：

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司(以下使用全称或其简称“交通银行”)	65%
施罗德投资管理有限公司	30%
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	5%

（二）主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

钱文挥先生，董事长，硕士学历。现任交通银行股份有限公司执行董事，副行长。历任中国建设银行资产负债管理委员会办公室主任兼上海分行副行长、资产负债管理委员会办公室主任兼体制改革办公室主任兼上海分行副行长、资产负债管理部总经理、资产负债管理部总经理兼重组改制办公室主任、交通银行股份有限公司副行长兼上海分行行长。

雷筑达先生，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、信贷处处长兼授信伺理处主任、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、信用风险管理部经理兼总经理助理、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，湘财存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

龙向东先生，基金经理，中国人民大学经济学学士、经济学硕士，美国加州大学河滨分校经济学博士，4年证券行业经验。曾先后担任英国剑桥大学商学院金融分析和政策中心研究员，美国雷曼兄弟公司(欧洲)量化分析师，日本野村国际（欧洲）量化分析师，北京健坤和创投资公司量化投资总监。2010年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任量化投资部副总经理，现任量化投资部总经理。2012年6月3日起担任本基金基金经理至今。

5、投资决策委员会成员

委员：项证锋（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：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
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：田青
联系电话：(010) 6759 5096

中国建设银行股份有限公司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(股票代码：939)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股公司首身恒生指数，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股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2012 年12月31日，中国建设银行资产总额139,728.28亿元，较上年末增长13.77%，2012年，中国建设银行实现净利润1,936.02亿元，较上年同期增长14.26%，年化资产回报率为1.47%，年化加权净资产收益率为21.98%。利息净收入3532.02亿元，较上年同期增长15.97%，净利差为2.58%，净利息收益率为2.75%，均较上年同期提高0.01个百分点。手续费及佣金净收入962.18亿元，较上年同期增长7.51%。

中国建设银行在中国内地设有4.1万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13 个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局。24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行26家，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2012年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的30多个重要奖项。在英国《银行家》杂志联合Brand Finance发布的“世界银行品牌500强”以及Interbrand发布的“2012年度中国最佳品牌”中，位列中国银行业首位；在美国《财富》杂志“世界500强排名”中列第77位，较上年上升31位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工210人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，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。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑经平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，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

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2012年12月31日，中国建设银行已托管285只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网2011年度和2012年度中国“最佳资产托管银行”奖、和讯网权威经济媒体《每日经济观察》2012年度“最佳基金托管银行”奖。

（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部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业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

投资托管业务部具备系统、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、投资独立性和风格甚差性等方面进行评价，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，电话或书面要求基金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
成立时间：2005年8月4日
电话：（021）61055027
传真：（021）61055054
联系人：许野
客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），（021）61055000
网址：www.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、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。网上直销交易平台网址：www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com。

2、场内代销机构

具有基金代销资格的上海证券交易所场内会员单位，名单详见上海证券交易所网站。

3、场外代销机构

（1）中国农业银行股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：蒋超良
传真：（010）85109219
客户服务电话：95599
网址：www.abchina.com

（2）中国建设银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
电话：（010）66275654
传真：（010）66275654
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com

（3）交通银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：牛锡明
电话：（021）58781234
传真：（021）58408483
联系人：曹榕
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

（4）招商银行股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道7088号
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：傅育宁
电话：（0755）83198888
传真：（0755）83195109
联系人：邓炯鹏
客户服务电话：95555
网址：www.cmbchina.com

（5）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

（6）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

（7）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：芮敏祺
客户服务电话：95521，400-8888-666
网址：www.gtja.com

（8）中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
电话：（010）85130588
传真：（010）65182261
联系人：魏明
客户服务电话：4008-888-108
网址：www.csc108.com

（9）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

（10）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

（11）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

（12）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

（13）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

（14）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

（15）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

（16）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

（17）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

（18）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

（19）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

（20）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

（21）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

（22）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

（23）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）88088858
传真：（010）88085195
联系人：李巍
客户服务电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

（24）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

（25）齐鲁证券有限公司
住所：山东省济南市市中区经七路86号
办公地址：山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
电话：（0531）68889155
传真：（0531）68889752
联系人：吴阳
客户服务电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

（26）平安证券有限责任公司
住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼(518048)
法定代表人：杨宇翔
电话：（0755）22627802
传真：（0755）82400862
联系人：郑舒丽
客户服务电话：95511-8
网址：www.pingan.com

（27）华宝证券有限责任公司
住所：中国上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27楼
办公地址：中国上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人：陈林
电话：（021）68777222
传真：（021）68777822
联系人：赵洁
客户服务电话：400-820-9898
网址：www.cnhbstock.com

（28）中国国际金融有限公司
住所：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：金立群
电话：（010）65051166
传真：（010）65058065
联系人：罗春蓉、武明明
网址：www.cicc.com.cn

（29）瑞银证券有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人：程宜荪
电话：（010）58328112
传真：（010）58328740
联系人：华冲
客户服务电话：400-887-8827
网址：www.ubssecurities.com

（30）国金证券股份有限公司
住所：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
电话：（028）86690126
传真：（028）86690126
联系人：金喆
客户服务电话：400-6600-109
网址：www.gjzq.com.cn

（31）方正证券股份有限公司
住所：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
电话：（0731)85832343
传真：（0731)85832342
联系人：彭博
客户服务电话：95571
网址：www.founder.sc.com

（32）渤海证券股份有限公司
住所：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：杜庆平
电话：（022）28451861
传真：（022）28451892
联系人：王兆权
客户服务电话：400-651-5988
网址：www.bhzq.com

（33）信达证券股份有限公司
住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人：高冠江
电话：（010）63081000
传真：（010）63080978
联系人：唐静
客户服务电话：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

（34）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

（35）中国中投证券有限责任公司
住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：龙增来
电话：（0755）82023442
传真：（0755）82026539
联系人：刘毅
客户服务电话：400-600-8008
网址：www.china-invs.cn

（36）华融证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市西城区金融大街8号
法定代表人：宋德清
电话：（010）58568235
传真：（010）58568062
联系人：黄恒
客户服务电话：（010）58568118
网址：www.hrsec.com.cn

（37）中原证券股份有限公司
住所：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号中原广发金融大厦17层
法定代表人：菅明军
电话：（0371）65585670
传真：（0371）65585665
联系人：程月艳、耿铭
客户服务电话：（0371）967218，400-813-9666
网址：www.ccnew.com

（38）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）66046578
网址：http://www.txsec.com，www.jjm.com.cn

（39）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：周曦旻
客户服务电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn

（40）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

（41）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

（42）上海好买基金销售有限公司
住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人：杨文斌
传真：（021）68596916
联系人：薛年
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

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）基金注册登记机构

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：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：安冬
经办律师：吕红、安冬

（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：上海市浦东新区陆家嘴环路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、屈厮洁

四、基金的名称

本基金名称：交银施罗德阿尔法核心股票型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金通过积极发挥团队选股优势，结合基本面多因子指标等组合管理手段选择具有显著阿尔法特征的个股，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，追求长期持续稳定高于业绩比较基准的投资回报。

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（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、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（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-95%；债券、货币市场工具、现金、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5%-40%，其中基金持有的权证不超过基金资产净值的3%，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，基金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，适时调整基金资产在股票、债券及货币市场工具等之间的配置比例。

八、基金的投资策略

本基金充分发挥基金管理的专业研究能力，以数量化工具辅助自上而下的资产配置，积极发挥研究团队的选股优势，结合基本面多因子指标自下而上精选个股，以谋求风险调整后的良好收益。

1、资产配置

本基金通过对宏观经济运行周期、货币与财政政策形势、资金面供求变化、证券市场走势与估值水平等综合分析，并借助量化工具积极判断市场时机，自上而下调整资产配置，控制系统性下跌风险。具体操作中，基金管理人融合量化投资方法，利用交银施罗德时机选择量化指标体系，作为对主观判断的重要补充，该指标体系主要从大类资产收益率比较、估值水平、市场流动性、通胀预期以及市场情绪等多维度对当前股票市场进行综合判断；当量化指标体系提示股票市场具有较大下行风险时，结合对中国宏观经济运行情况的判断和预测，本基金将相应采取降低风险禁露的措施，控制下行风险；反之，当量化指标体系揭示股票市场面临较大机会上涨时，结合对中国宏观经济运行情况的判断和预测，本基金将相应提高股票资产配置比例，捕捉系统性投资机会。

2、行业配置

关于行业配置权重，本基金在充分考虑市场均衡的行业配置比例基础上加入基金管理人对各个行业风险收益的预期，在基金整体风险可控基础上实现行业的合理配置和优化。具体而言，本基金参考申银万国行业分类框架，并结合基金管理人对上市公司业务本质和驱动因素的理解，将全市场所有上市公司进行内部行业划分，行业分析师据此分工对各细分行业进行深入的行业分析，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；然后本基金利用交银施罗德研究团队的上述行业研究成果，主要参考投资时钟理论、宏观策略分析师以及行业分析师对所处经济周期和各行业趋势的看法和判断，形成行业配置的内部预期观点；同时，根据市场均衡状态推导出市场隐含的外部预期观点；基金管理人把外部预期观点和内部预期观点相结合，形成行业配置权重，使组合达到最优的预期风险收益。

3、股票投资

本基金认为，研究团队的选股能力是团队的核心优势，并正是获得Alpha的有效来源之一。因此，本基金将综合运用交银施罗德股票研究分析方法和其它投资分析工具，充分发挥研究团队“自下而上”的主动选股能力基础上，进一步通过交银施罗德研发的本面多因子模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上精选具有投资潜力、阿尔法特征显著的股票构建投资组合。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）价值评估

在公司备选股票池基础上，本基金将进一步通过行业分析师对备选上市公司翔实的案头分析和深入的实地调研，以定性与定量相结合的方法对公司价值进行综合评估，构建股票组合。其中本基金将重点关注具以下特征的优质上市公司：

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；
④ 公司财务状况良好，具备一定的规模优势和抵好的抗风险能力；
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。

在行业分析师对重点上市公司的基本面分析基础之上，本基金会对股票池中的股票做进一步量化筛选，根据基本面多因子指标对股票评分，并辅之以必要的主观判断。其中，多因子指标内生包括PB、PE等指标。

这样，本基金对上述重点上市公司进行内在价值的评估和成长性跟踪研究，并辅以多因子量化评分及主观筛选方法后，在明确的价值评估基础上选择具备Alpha值较高的投资标的构建股票组合；并利用风险模型和组合优化模型来确定个股权重，优化目标是使投资组合的风险调整后