交银施罗德荣安保本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：中信银行股份有限公司

二〇一三年十二月

基金招募说明书自基金合同生效日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日。

【重要提示】

交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2012年4月26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【2012】565号文核准募集。本基金基金合同于2012年6月20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：市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、本基金投资策略所特有的风险、担保风险、本基金到期期间操作所特有的风险等等。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。投资人投资于本保本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，投资人投资本基金仍然存在本金损失的风险。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不代表未来表现。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12月20日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年9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。历任宏达信（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。

孟方德先生，董事，硕士学历。历任施罗德投资管理有限公司分析师、投资经理，施罗德投资管理（新加坡）有限公司副董事长，施罗德投资管理国际有限公司执行董事，施罗德投资管理（卢森堡）有限公司总经理，施罗德投资管理（日本）有限公司总经理，施罗德投资管理有限公司英国区总经理及销售总监、全球渠道销售业务总监，现任施罗德投资管理有限公司亚太区总裁。

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、瑞安经营中心主任。

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、交银施罗德资产管理（香港）有限公司总裁。

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

项廷锋先生，基金经理，上海交通大学管理学博士，14年基金从业经验。1999年至2007年任职于华安基金管理有限公司，先后担任研究员、固定收益投资经理和基金经理。其中2003年12月30日至2007年5月15日担任华安现金富利投资基金基金经理。2007年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任固定收益部总经理，现任投资总监。2012年6月20日起担任本基金基金经理至今，2013年4月24日起担任交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金经理至今，2013年12月25日起担任交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金经理至今。

林洪钧先生，基金经理助理。学士学历。9年证券、基金业从业经验。历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理，华安基金管理有限公司债券交易员，加拿大Financial Engineering Source Inc.金融研究员。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任专户投资经理助理和专户投资经理，现任固定收益部助理总经理。2011年1月27日起担任交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金经理至今，2011年6月9日起兼任交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理至今，2012年11月5日起兼任交银施罗德理财21天债券型证券投资基金基金经理至今，2013年4月16日起兼任本基金基金经理助理至今，并于2013年4月24日起兼任交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金经理助理至今。

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（权益投资总监、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）

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：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）
住所：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：常振明
成立时间：1987年4月7日
组织形式：股份有限公司
注册资本：467.873亿元人民币
存续期间：持续经营
批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125号
联系人：中信银行资产托管部
联系电话：010-65558812
传真：010-65550832
客服电话：95558
网址：bank.ecitic.com

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同行业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

中信银行（601998.SH、0998.HK）成立于1987年，原名中信实业银行，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以崭创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展，中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大，于2005年8月，正式更名“中信银行”。2006年12月，以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东，正式成立中信银行股份有限公司。同年，成功引进战略投资者，与欧洲领先的西班牙对外银行（BBVA）建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日，中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009年，中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司（简称：中信国金）70.32%股权。经过二十多年的发展，中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一，是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

2009年，中信银行通过了美国SAS70内部控制审订并获得无保留意见的SAS70审订报告，表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

2、主要人员情况

朱小黄先生，中信银行行长，高级经济师，并获中国政府特殊津贴。1982年湖北财经学院基建财务与信用专业大学本科毕业，1985年北京大学经济法专业专科毕业，2006年中山大学世界经济专业博士毕业。曾任中国建设银行股份有限公司副行长兼首席风险官。现任中国中信集团有限公司党委委员、中国中信股份有限公司副总经理、中信银行党委书记及行长。

曹国强先生，中信银行副行长，分管托管业务。曾担任人民银行陕西省分行计划资金处副处长，招商银行深圳管理部计划资金部总经理，招商银行总行计划资金部总经理，中信银行计划财务部总经理，中信银行行长助理。

刘勇先生，中信银行托管中心总经理。男，1965年出生，中共党员，硕士研究生。曾任中信银行贸易结算部副总经理，中信银行总行营业部国际业务部总经理，中信银行国际业务管理部总经理，中信银行上海分行行长助理兼风险主管，中信银行国际业务部副总经理。2007年6月至今，任中信银行资产托管部总经理，负责全行托管业务。

3、基金托管业务经营情况

2004年8月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2013年9月30日，中信银行已托管30只开放式证券投资基金及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，总托管规模逾1.7万亿元人民币。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标：强化内部管理，确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；建立完善的规章制度和操作规程，保证基金托管业务持续、稳健发展；加强稽核监察，建立高效的风险监控体系，及时有效地发现、分析、控制和避免风险，确保基金财产安全，维护基金份额持有人利益。

2、内部控制组织结构：中信银行总行建立了风险管理委员会，负责全行的风险控制和风险防范工作；托管部内设内控合规岗，专门负责托管部内部风险控制，对基金托管业务的各个工作环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核监察。

3、内部控制制度：中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业务内控检查实施细则》等一整套规章制度，涵盖证券投资基金托管业务的各个环节，保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发展。

4、内部控制措施：建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规范等，从制度上、人员上保证基金托管业务稳健发展；建立了安全保管基金财产的物质条件，对业务运行场所实行封闭管理，在要害部门和岗位设立了安全保密区，安装了录像、录音监控系统，保证基金信息的安全；建立严密的内部控制防线和业务授权管理等制度，确保所托管的基金财产独立运行；营造良好的内部控制环境，开展多种形式的持续培训，加强职业道德教育。

（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

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定，对基金的投资运作、基金资产净值计算、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的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。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。基金托管人发现基金管理人有重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

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.fund001.com，www.bocomschroder.com

个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理开户、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.fund001.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）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

（5）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

（6）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

（7）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：常振明
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

（8）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

（9）杭州银行股份有限公司
住所：杭州市庆春路46号杭州银行大厦
办公地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦
法定代表人：吴太普
电话：(0571)85108309
传真：(0571)85151339
联系人：严峻
客户服务电话：(0571)96523，400-8888-508
网址：www.hzbank.com.cn

（10）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：袁长清（代行）
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

（11）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

（12）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

（13）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

（14）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

（15）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

（16）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

（17）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：谢商得
客户服务电话：400-8888-123
网址：www.xyzq.com.cn

（18）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

（19）中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

（20）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

（21）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

（22）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

（23）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
电话：(021)32229888
传真：(021)68728703
联系人：陈敏
客户服务电话：(021)63340678
网址：www.ajzq.com

（41）长城证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
电话：(0755)83516289
传真：(0755)83516199
联系人：匡婷
客户服务电话：(0755)33680000，400-6666-888
网址：www.cc168.com.cn

（42）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

（43）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.foundersc.com

（44）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

（45）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

（46）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

（47）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

（48）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

（49）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

（50）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

（51）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

（52）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1、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1、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

（53）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

（54）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

（55）诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼
法定代表人：汪静波
电话：(021)38600735
传真：(021)38509777
联系人：方成
客户服务电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com

（56）和讯信息科技有限公司
住所：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
电话：(021)20835789
传真：(021)20835879
联系人：周轶
客户服务电话：4009200022
网址：http://licaike.hexun.com/

（57）上海天天基金销售有限公司
住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人：其实
电话：(021)54509998
传真：(021)64385308
联系人：潘世友
客户服务电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn

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：黎明
经办律师：吕红、黎明

（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：沈炜杰
经办注册会计师：汪棣、叶尔甸

四、基金的名称

本基金名称：交银施罗德荣安保本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、基金的保本

本基金为基金份额持有人持有到期的基金份额提供的保本金额为：本基金募集期内认购本基金的投资人认购并持有到期的基金份额的认购金额（即认购保本金额，包括该等基金份额的净认购金额、认购费用以及募集期间的认购利息），以及发生本基金转入下一保本周期的情形时，在过渡期内进行申购的投资人申购并持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值，以及从本基金上一个保本周期结束后默认选择转入当期保本周期的基金份额持有人在上一个保本周期持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值，按照基金合同其他约定未获得可享受保本条款确认的基金份额除外。

在保本周期到期日，如基金份额持有人持有到期的基金份额的可赎回金额加上其持有到期的基金份额在当期保本周期内累计分红金额之和计算的总金额低于其保本金额（低出的部分即为“保本差额”），则基金管理人或保本义务人应补足该保本差额，并在保本周期到期日后20个工作日内将该保本差额支付给基金份额持有人。

发生基金合同约定的不适用保本条款情形的，相应基金份额不适用本保本条款。

七、基金的投资目标

本基金在追求保本周期到期时本金安全的基础上，通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，力争实现保本周期内基金资产的稳定增长。

八、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，包括国内依法公开发行交易的债券、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币市场工具、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，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金的基金资产包括稳健资产和风险资产，稳健资产为国内依法发行交易的债券和货币市场工具等，其中债券包括国债、金融债、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、债券回购等。风险资产为股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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：债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的 60%-100%，其中基金应保留不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；股票、权证等风险资产占基金资产的0%-40%，其中，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。

九、基金的投资策略

本基金运用恒定比例组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）原理，动态调整稳健资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。

具体而言，本基金的投资策略包括资产配置策略、稳健资产投资策略和风险资产投资策略。

（1）资产配置策略

本基金基于恒定比例组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）原理对稳健资产和风险资产进行配置，动态调整稳健资产与风险资产投资的比例，通过对稳健资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全，通过对风险资产的投资寻求保本周期内资产的稳定增值。本基金对稳健资产和风险资产的资产配置具体可分为以下四步：

第一步，确定本基金的价值底线（Floor）。根据本基金保本周期到期时投资组合的最低目标价值（本基金的最低保本值为投资本金的100%）和合理的贴现率，确定本基金当前应持有的稳健资产数额，亦即本基金的价值底线（Floor）。

第二步，计算本基金的安全垫（Cushion）。通过计算基金投资组合现时净值超越价值底线的数额，得到本基金的安全垫（Cushion）。

第三步，确定风险乘数（Multiplier）。本基金通过对宏观经济和证券市场运行状况和趋势的判断，并结合基金的风险收益情况，确定安全垫的放大倍数——风险乘数，并在安全垫和风险乘数确定的基础上，得到当期风险资产的最高配置规模与比例。

第四步，动态调整稳健资产和风险资产的配置比例，并结合市场实际运行态势制定风险资产投资策略，进行投资组合管理，实现基金资产在保本基础上的保值增值。

（2）稳健资产投资策略

本基金通过分析判断宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化，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，在确保基金资产收益安全性和稳定性的基础上，构造债券组合。

1）免疫策略

本基金采用剩余期限与保本周期到期期限匹配的积极投资策略，根据保本周期的剩余期限动态调整稳健资产债券组合久期，有效控制债券利率、收益率曲线等各种风险，保证债券组合收益的稳定性。

2）收益率曲线策略

本基金将结合对收益率曲线变化的预测，适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整，从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。

3）相对价值策略

本基金通过对不同债券市场、债券品种及信用等级的债券间利差的分析判断，获取不合理的市场定价所带来的投资机会。

4）骑乘策略

本基金通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，持有一定时间后，随着债券剩余期限的缩短，到期收益率将迅速下降，基金可获得较高的资本利得收入。

5）回购策略

本基金将适时运用回购交易套利策略，在确保基金资产安全的前提下增强债券组合的收益率。

6）信用债投资策略

本基金将采用内部信用评级和外部信用评级相结合的方法，通过对信用产品基本面的研究，形成对该信用产品信用级别综合评定，并通过调整组合内信用产品在信用等级和剩余期限方面的分布，获取超额收益。

（3）风险资产投资策略

1）股票投资策略

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，通过优选具有良好成长性、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。

① 行业配置

本基金通过对宏观经济运行趋势、产业环境、产业政策和行业竞争格局等多因素的分析和预测，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，据此挑选出具有良好景气和发展潜力的行业。

② 个股选择

本基金综合运用交银施罗德的股票研究分析方法和其它投资分析工具挑选具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票构建股票投资组合。具体分以下三个层次进行：

a）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（如P/E、P/Cash Flow、P/FCF、P/S、P/EBIT等），经营效率（如ROE、ROA、Return on operating assets等）和财务状况（如D/A、流动比率等）等。

b）公司质量评价

通过对上市公司直接接触和实地调研，了解并评估公司治理结构、公司战略、所处行业的竞争动力、公司的财务特点，以决定股票的合理估值中应该考虑的折价或溢价水平。在调研基础上，分析员依据公司成长性、盈利能力可预见性、盈利质量、管理层素质、流通股东受关注程度五大质量排名标准给每个目标公司进行评分。

c）