（上接B69版）

四、基金的名称

本基金名称：交银施罗德货币市场证券投资基金。

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

本基金属于货币市场基金，投资目标是在力求本金稳妥和资产充分流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于货币市场工具，包括：

1、现金；
2、通知存款；
3、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；
4、剩余期限在397天以内（含397天）的债券；
5、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；
6、期限在一年以内（含一年）的债券回购；
7、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券；
8、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

八、基金的投资策略

（一）短期利率水平预期策略

深入分析国家货币政策、短期资金市场利率波动、资本市场资金面的情况和流动性的变化，对短期利率走势形成合理预期，并据此调整基金货币资产的配置策略。

（二）收益率曲线分析策略

根据收益率曲线的变化趋势，采取相应的投资管理策略。货币市场收益率曲线的形状反映当时短期利率水平之间的关系，反映市场对较短期限经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。

（三）组合剩余期限策略、期限配置策略

通过对组合资产剩余期限的设计、跟踪、调整，达到保持合理的现金流，锁定组合剩余期限，以满足可能的、突发的现金需求，同时保持组合的稳定收益；特别在债券投资中，根据收益率曲线的情况，投资一定剩余期限的品种，稳定收益，锁定风险，满足组合目标期限。

（四）类别品种配置策略

在保持组合资产相对稳定的条件下，根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

（五）流动性管理策略

在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下，通过基金资产安排（包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他措施），在保持基金资产高流动性的前提下，确保基金的稳定收益。

（六）无风险套利策略

无风险套利策略包括：

跨市场套利策略：根据各细分短期金融工具的流动性和收益特征，动态调整基金资产在各个细分市场之间的配置比例。如，当交易所市场回购利率高于银行间市场回购利率时，可增加交易所市场回购的配置比例；另外，还包括一级市场发行定价和二级市场流通成交价之间的无风险套利机会。

跨品种套利策略：根据各细分市场中不同品种的风险参数、流动性补偿和收益特征，动态调整不同期限结构品种的配置比例。

（七）滚动配置策略

根据具体投资品种的市场特性，采用持续滚动投资的方法，以提高基金资产的整体持续的变现能力。如，对N天期回购协议进行每天等量配置，提高基金资产的流动性；在公开市场操作中，跟随人民银行每周的滚动发行，持续同品种投资，达到剩余期限的直线分布。

（八）信用利差策略

通过对资产支持证券的信用评估，分析预期违约率和违约损失率的变化趋势，评估其信用利差是否合理，并预测其变化趋势，通过其信用质量的改善和信用利差的缩小获利。

九、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准为六个月银行定期存款利率（税后）。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用，基金管理人可根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。

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。

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于2015年7月17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。

本投资组合报告期为2015年4月1日起至6月30日，所载财务数据未经审计师审计。

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	固定收益投资	3,999,832,891.20	47.51
	其中：债券	3,999,832,891.20	47.51
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	756,355,162.81	8.98
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	101,252,940.16	1.20
3	银行存款和结算备付金合计	3,472,277,966.54	41.25
4	其他资产	190,138,815.45	2.26
5	合计	8,418,604,836.00	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	2.96	
	其中：买断式回购融资	–	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	999,998,980.00	13.52
	其中：买断式回购融资	–	–

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3、基金投资组合平均剩余期限

（1）投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	70

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过180天。

（2）报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	29.35	13.52
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	35.30	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	7.85	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—180天	15.63	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397天（含）	23.82	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
合计		111.95	13.52

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	摊余成本（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	532,790,064.83	7.20
	其中：政策性金融债	532,790,064.83	7.20
4	企业债券	39,880,406.45	0.54
5	企业短期融资券	3,427,162,419.92	46.33
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	3,999,832,891.20	54.08
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150403	15农发03	3,500,000	352,013,684.44	4.76
2	011537005	15中建材SCP005	2,500,000	250,052,198.02	3.38
3	011586006	15光明SCP006	2,000,000	199,959,732.35	2.70
4	041555013	15陕延油CP001	2,000,000	199,929,268.06	2.70
5	041562020	15沪世茂CP002	2,000,000	199,918,687.33	2.70
6	011586003	15光明SCP003	1,100,000	110,341,245.03	1.49
7	011510003	15中电投SCP003	1,000,000	100,727,827.62	1.36
8	041558027	15苏通桥CP001	1,000,000	100,000,119.50	1.35
9	011599233	15苏国信SCP003	1,000,000	99,996,170.22	1.35
10	011599310	15厦国贸SCP004	1,000,000	99,991,346.28	1.35

6、"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1674%
报告期内偏离度的最低值	0.0547%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1136%

7、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。

8、投资组合报告附注

（1）基金计价方法说明。

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率和摊余成本逐日摊销计算损益。

（2）本基金报告期每日持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本均未超过当日基金资产净值的20%。

（3）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。

（4）其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	52,154,784.93
3	应收利息	55,586,099.55
4	应收申购款	82,397,930.97
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	190,138,815.45

（5）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2015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。

（一）基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

	阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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级	过去三个月	0.8588%	0.0063%	0.5364%	0.0004%	0.3224%	0.0059%
	2015年度上半年	1.8340%	0.0058%	1.1440%	0.0006%	0.6900%	0.0052%
	2014年度	4.4725%	0.0055%	2.7726%	0.0002%	1.6999%	0.0053%
	2013年度	3.5646%	0.0034%	2.8000%	0.0000%	0.7646%	0.0034%
	2012年度	3.7384%	0.0030%	3.0447%	0.0007%	0.6937%	0.0023%
	2011年度	3.2554%	0.0036%	3.0748%	0.0007%	0.1806%	0.0029%
	2010年度	1.5968%	0.0023%	2.0289%	0.0003%	-0.4321%	0.0020%
	2009年度	1.3396%	0.0049%	1.9800%	0.0000%	-0.6404%	0.0049%
	2008年度	3.3151%	0.0083%	3.4340%	0.0011%	-0.1189%	0.0072%
	2007年度	3.2219%	0.0063%	2.4441%	0.0017%	0.7778%	0.0046%
	2006年度（自基金合同生效日至2006年12月31日）	1.6718%	0.0022%	1.6231%	0.0002%	0.0487%	0.0020%
B级	过去三个月	0.9191%	0.0063%	0.5364%	0.0004%	0.3827%	0.0059%
	2015年度上半年	1.9552%	0.0058%	1.1440%	0.0006%	0.8112%	0.0052%
	2014年度	4.7230%	0.0055%	2.7726%	0.0002%	1.9504%	0.0053%
	2013年度	3.8128%	0.0034%	2.8000%	0.0000%	1.0128%	0.0034%
	2012年度	3.9871%	0.0030%	3.0447%	0.0007%	0.9424%	0.0023%
	2011年度	3.5014%	0.0036%	3.0748%	0.0007%	0.4266%	0.0029%
	2010年度	1.8421%	0.0023%	2.0289%	0.0003%	-0.1868%	0.0020%
	2009年度	1.5829%	0.0048%	1.9800%	0.0000%	-0.3971%	0.0048%
	2008年度	3.5615%	0.0083%	3.4340%	0.0011%	0.1275%	0.0072%
	2007年度（自基金分级日起至2007年12月31日）	2.1597%	0.0080%	1.5446%	0.0013%	0.6151%	0.0067%

注：本基金收益分配按月结转份额。

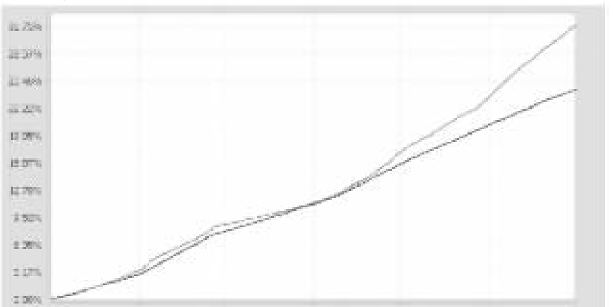
（二）自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德货币市场证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

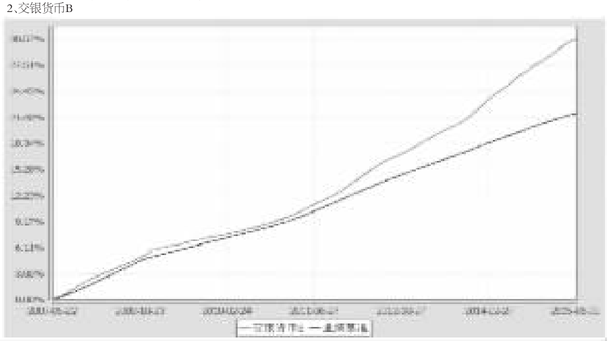
（2006年1月20日至2015年6月30日）

1、 交银货币A



注：图示日期为2006年1月20日至2015年6月30日。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，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、交银货币B



注：图示日期为2007年6月22日至2015年6月30日。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，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、 基金销售服务费；
4、 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5、 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
6、 基金份额持有人大会费用；
7、 基金的证券交易费用；
8、 按照国家有关规定和基金合同约定可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金基金合同终止清算时所发生费用，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

本基金的管理费按基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.33%÷当年天数

H为每日应付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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款指令，基金托管人复核后于次月前2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、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2. 与基金销售有关的费用

（1）申购费

本基金申购费的费率为零。

申购份额的计算如下：

申购总金额=申请总金额

申购份额＝申购金额÷基金份额净值

例一：假定T日某投资人投资10,000元申购本基金，则其可得到的申购份额计算如下：

申购份额=10,000/1.00=10,000份

申购份数保留至小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，四舍五入部分所代表的资产归基金所有。

（2）赎回费

本基金赎回费的费率为零。

基金赎回金额的计算如下：

赎回金额=赎回份额×基金份额净值+该份额对应的未付收益

例二：假定某投资人在T日赎回10,000份本基金，且假设该10,000份基金份额对应的未支付收益为15.00元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000×1.00+15.00=10,015.00元

赎回总额以人民币元为单位，保留至小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，四舍五入部分所代表的资产归基金所有。

（3）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）转出基金的赎回费用

转出基金的赎回费用按照各基金最新的更新招募说明书及相关公告规定的赎回费率和计费方式收取，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。

3）前端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从不收取申购费用的基金或前端申购费用低的基金向前端申购费用高的基金转换，收取前端申购补差费用；从前端申购费用高的基金向前端申购费用低的基金或不收取申购费用的基金转换，不收取前端申购补差费用。申购补差费用原则上按照转出确认金额对应分档的转入基金前端申购费率减去转出基金前端申购费率差额进行补差，转出与转入基金的申购补差费率按照转出确认金额分档，并随着转出确认金额递减。

4）后端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从不收取申购费用的基金或后端申购费用低的基金向后端申购费用高的基金转换，不收取后端申购补差费用，但转入的基金份额赎回的时候需全额收取转入基金的后端申购费；从后端申购费用高的基金向后端申购费用低的基金或不收取申购费用的基金转换，收取后端申购补差费用，且转入的基金份额赎回的时候需全额收取转入基金的后端申购费。后端申购补差费用按照转出份额持有时间对应分档的转出基金后端申购费率减去转入基金后端申购费率差额进行补差。

5）网上直销的申购补差费率优惠

为更好服务投资者，本基金管理人已开通基金网上直销业务，个人投资者可以通过"网上直销交易平台"办理基金转换业务，其中部分转换业务可享受转换费率优惠，优惠费率只适用于转出与转入基金申购补差费用，转出基金的赎回费用无优惠。可通过网上直销交易平台办理的转换业务范围及转换费率优惠的具体情况请参阅本基金管理人网站。

具体转换费率水平请参见本基金管理人网站（www.fund001.com，www.bocomschroder.com）列示的相关转换费率表或相关公告。

6）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在实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

（4）基金转换份额的计算公式

1）前端收费模式下基金转换份额的计算公式及举例

转出确认金额=转出的基金份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金的赎回费=转出确认金额×对应的转出基金的赎回费率

转入确认金额=转出确认金额-转出基金的赎回费

转出与转入基金的申购补差费=转入确认金额×对应的转出与转入基金的申购补差费率/（1+对应的转出与转入基金的申购补差费率）

（注：对于适用固定金额申购补差费用的，转出与转入基金的申购补差费＝固定金额的申购补差费）

转入基金确认份额=（转入确认金额-转出与转入基金的申购补差费+A）/转换申请当日转入基金的基金份额净值

其中：

A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A为0）。

转入基金确认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：某投资者持有交银趋势前端收费模式的基金份额100,000份，持有期半年，转换申请当日交银趋势的基金份额净值为1.010元，交银成长的基金份额净值为2.2700元。若该投资者将100,000份交银趋势前端基金份额转换为交银成长前端基金份额，则转入交银成长确认的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.010=101,000元
转出基金的赎回费=101,000×0.5%=505元
转入确认金额=101,000−505=100,495元
转出与转入基金的申购补差费=100,495×0/（1+0）=0元
转入基金确认份额=（100,495−0）/2.2700=44,270.93份

例二：某投资者持有交银增利A类基金份额1,000,000份，持有期一年半，转换申请当日交银增利A类基金份额的基金份额净值为1.0200元，交银趋势的基金份额净值为1.010元。若该投资者将1,000,000份交银增利A类基金份额转换为交银趋势前端基金份额（非网上交易），则转入交银趋势确认的基金份额为：

转出确认金额=1,000,000×1.0200=1,020,000元
转出基金的赎回费=1,020,000×0.05%=510元
转入确认金额=1,020,000−510=1,019,490元
转出与转入基金的申购补差费=1,019,490×0.5%/（1+0.5%）=5,072.09元
转入基金确认份额=（1,019,490−5,072.09）/1.010=1,004,374.17份

例三：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（非网上交易），则转入交银精选确认的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.2500=125,000元
转出基金的赎回费=0元
转入确认金额=125,000−0=125,000元
转出与转入基金的申购补差费=125,000×1.5%/（1+1.5%）=1,847.29元
转入基金确认份额=（125,000−1,847.29）/2.2700=54,252.30份

例四：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（非网上交易），则转入确认的交银增利A类基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.00=100,000元
转出基金的赎回费=0元
转入确认金额=100,000−0=100,000元
转出与转入基金的申购补差费=100,000×0.8%/（1+0.8%）=793.65元
转入基金确认份额=（100,000−793.65+61.52）/1.2700=78,163.68份

2）后端收费模式下基金转换份额的计算公式及举例

转出确认金额=转出的基金份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金的赎回费=转出确认金额×对应的转出基金的赎回费率

转入确认金额=转出确认金额-转出基金的赎回费

转出与转入基金的申购补差费=转入确认金额×对应的转出与转入基金的申购补差费率

转入基金确认份额=（转入确认金额-转出与转入基金的申购补差费+A）/转换申请当日转入基金的基金份额净值

其中：

A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A为0）。

转入基金确认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。

例五：某投资者持有交银主题后端收费模式的基金份额100,000份，持有期一年半，转换申请当日交银主题的基金份额净值为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份交银主题后端基金份额转换为交银稳健后端基金份额，则转入交银稳健确认的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.250=125,000元
转出基金的赎回费=125,000×0.2%=250元
转入确认金额=125,000−250=124,750元
转出与转入基金的申购补差费=124,750×0=0元
转入基金确认份额=（124,750−0）/2.2700=54,955.95份

例六：某投资者持有交银先锋后端收费模式的基金份额100,000份，持有期一年半，转换申请当日交银先锋的基金份额净值为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份交银先锋后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：

转出确认金额=100,000×1.250=125,000元
转出基金的赎回费=125,000×0.2%=250元
转入确认金额=125,000−250=124,750元
转出与转入基金的申购补差费=124,750×1.2%=1497元
转入基金确认份额=（124,750−1497）/1.00=123,253.00份

例七：某投资者持有交银蓝筹后端收费模式的基金份额100,000份，持有期三年半，转换申请当日交银蓝筹的基金份额净值为0.8500元，交银增利B类基金份额的基金份额净值为1.0500。若该投资者将100,000份交银蓝筹后端基金份额转换为交银增利B类基金份额，则转入交银增利B类基金份额的基金份额为：

转出确认金额=100,000×0.850=85,000元
转出基金的赎回费=85,000×0=0元
转入确认金额=85,000−0=85,000元
转出与转入基金的申购补差费=85,000×0.2%=170元
转入基金确认份额=（85,000−170）/1.0500=80,790.48份

例八：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B类基金份额，则转入确认的交银增利B类基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.00=100,000元
转出基金的赎回费=0元
转入确认金额=100,000−0=100,000元
转出与转入基金的申购补差费=100,000×0=0元
转入基金确认份额=（100,000−0+61.52）/1.2700=78,788.60份

(5) 网上直销的有关费率

本基金管理人已开通基金网上直销业务，个人投资者可以直接通过本公司网站的"交银施罗德基金管理有限公司网上直销交易平台"（以下简称"网上直销交易平台"）办理开户和本基金的申购、赎回、定期定额投资和转换等业务。通过网上直销交易平台办理本基金转换出业务的个人投资者将享受转换费中相应申购补差费率的优惠，其他费率标准不变。具体优惠费率请参见公司网站列示的网上直销申购、定期定额投资及转换费率表或相关公告。

本公司基金网上直销业务已开通的银行卡及各银行卡交易金额限额请参阅本公司网站。

个人投资者通过本基金管理人网上直销交易平台申购本基金的单笔最低金额为100元（含），单笔定期定额投资最低金额为100元（含），单笔转换份额不得低于100份，投资者可将其全部或部分基金份额转换成其它基金，单笔转换申请不受转入基金最低申购限额限制。

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。

（6）销售服务费

本基金各级基金份额按照不同的费率计提销售服务费，在通常情况下，本基金A级基金份额的销售服务费年费率为0.25%，B级基金份额的年费率为0.01%。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

H＝E×R÷当年天数

H为每级基金份额每日应计提的销售服务费

E为前一日该级基金份额的基金资产净值

R为该级基金份额的销售服务费率

基金管理人可以调整对各级基金份额计提的销售服务费率，但销售服务费年费率最高不超过0.25%。基金管理人应在调整前依照《信息披露办法》和《信息披露特别规定》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告并报中国证监会备案。

基金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基金销售管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前2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。

基金销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金营销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

上述（一）基金费用的种类中4—8项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，从基金财产中支付。

（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。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用，不得从基金财产中列支。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

（四）基金管理费、托管费、销售服务费率的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率。调高基金管理费率、基金托管费率、销售服务费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率、销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》和《信息披露特别规定》的有关规定在指定媒体上公告。

（五） 基金税收

基金运作过程中涉及的各类纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

总体更新

（一）更新了"重要提示"中相关内容。
（二）更新了"三、基金管理人"中相关内容。
（三）更新了"四、基金托管人"中相关内容。
（四）更新了"五、相关服务机构"中相关内容。
（五）更新了"十一、基金的投资"中"基金投资组合报告"相关内容，数据截止到2015年6月30日。
（六）更新了"十二、基金的业绩"中相关内容，数据截止到2015年6月30日。
（七）更新了"二十二、托管协议的内容摘要"中相关内容。
（八）更新了"二十四、其他应披露事项"中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
二〇一五年九月二日

（上接B70版）

如果上述基准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基准，则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后，调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

2、转为开放式运作后的业绩比较基准

中债综合全价指数

中债综合全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，其指数样本涵盖国债、政策性银行债、商业银行债、地方企业债、中期票据以及证券公司短期融资券等各类券种，综合反映了债券市场整体价格和回报情况，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。该指数合理、透明、公开，具有较好的市场接受度，作为衡量本基金比较基准较为合适。

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，则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后，调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告，而无需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，其风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种。

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。

本基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年7月17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2015年4月1日至2015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	–	–
	其中：股票	–	–
2	固定收益投资	513,629,728.30	95.40
	其中：债券	463,604,128.30	86.11
	资产支持证券	50,025,600.00	9.29
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	11,919,330.71	2.21
7	其他资产	12,835,588.01	2.38
8	合计	538,384,647.02	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	290,798,128.30	107.64
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	172,806,000.00	63.96
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	463,604,128.30	171.60

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	112043	11东控02	240,000	24,962,400.00	9.24
2	1280135	12昆钢控股债	240,000	24,228,000.00	8.97
3	112233	14漳发债	230,000	23,388,700.00	8.66
4	112197	13山证01	206,870	21,326,228.30	7.89
5	122362	14沪实债	200,000	20,698,000.00	7.66

6、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	119122	15金通A2	200,000	20,025,600.00	7.41
2	119146	15蚂蚁1A	200,000	20,000,000.00	7.40
3	119163	15中和1A	100,000	10,000,000.00	3.70

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、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	897,840.67
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	11,927,088.76
5	应收申购款	–
6	其他应收款	10,658.58
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	12,835,588.01

（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）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

（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2015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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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

（1）交银丰享收益债券：

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	4.30%	0.09%	0.74%	0.01%	3.56%	0.08%
自基金合同生效日起至今(2015年1月19日至2015年6月30日)	4.20%	0.09%	1.39%	0.01%	2.81%	0.08%

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

交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2015年1月19日至2015年6月30日）

注：本基金基金合同生效日为2015年1月19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2015年6月30日，本基金尚处于建仓期。

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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、基金的开户费用、账户维护费用；
9、本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.8%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起第3个工作日从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人复核后于次月首日起第3个工作日从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

（3）C类基金份额的销售服务费

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在封闭期内按前一日C类基金资产净值的0.6%年费率计提，在转入开放式运作后按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年销售服务费率÷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

年销售服务费率在基金封闭期内为0.6%，转入开放式后为0.4%

C类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人复核后于次月首日起第3个工作日从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

C类基金份额的销售服务费将专门用于本基金的推广、销售与基金份额持有人服务。

2、与基金销售有关的费用

（1）申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式详见基金招募说明书全文"基金份额的申购与赎回"一章。

（2）赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式详见基金招募说明书全文"基金份额的申购与赎回"一章。

3、上述"（一）基金费用的种类"中第3－8项、第10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）在符合法律法规及本基金基金合同规定、并且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和C类基金份额销售服务费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率和C类基金份额销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

总体更新

（一）更新了"重要提示"中相关内容。
（二）更新了"三、基金管理人"中相关内容。
（三）更新了"四、基金托管人"中相关内容。
（四）更新了"五、相关服务机构"中相关内容。
（五）更新了"六、基金的募集"中相关内容。
（六）更新了"七、基金合同的生效"中相关内容。
（七）更新了"八、基金份额的申购与赎回"中相关内容。
（八）更新了"九、基金的投资"中"基金投资组合报告"相关内容，数据截止到2015年6月30日。
（九）更新了"十、基金的业绩"中相关内容，数据截止到2015年6月30日。
（十）更新了"十二、基金资产的估值" 中上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种估值方法改为主要依据第三方估值机构提供的价格数据进行估值。
（十一）更新了"十四、基金的费用与税收"中相关内容。
（十二）更新了"二十、托管协议的内容摘要"中相关内容
（十三）更新了"二十一、对基金份额持有人的服务"中相关内容。
（十四）更新了"二十二、其他应披露事项" 中相关内容。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一五年九月二日

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称"基金合同"）、《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称"招募说明书"）中关于不定期份额折算的相关规定，当长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之积极份额（场内简称：中小300B，基金代码：150058）的份额参考净值在某一开放日小于或等于0.250元时，长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称：长城久兆，基金代码：162010）、长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之稳健份额（场内简称：中小300A，基金代码：150057）、长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之积极份额（场内简称：中小300B，基金代码：150058）将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2015年9月1日，中小300B的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件，因此本基金管理人敬请投资者密切关注中小300B近期的参考净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、由于中小300A、中小300B折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，中小300A、中小300B的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

二、中小300B表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

三、由于触发折算阈值当日，中小300B的份额参考净值可能已低于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日中小300B的份额参考净值可能与折算阈值0.250元有一定差异。

四、中小300A表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后中小300A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的中小300A变为同时持有较低风险收益特征的中小300A与较高风险收益特征的长城久兆份额的情况，因此中小300A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示：

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量长城久兆份额、中小300A、中小300B的持有人存在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金资产的风险。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作，本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停中小300A与中小300B的上市交易和长城久兆份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解本基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及招募说明书或者拨打本基金管理人客服电话：400－8868－666（免长途话费）。

特此公告

长城基金管理有限公司
2015年9月2日

长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（【2008】38号）及中国证券业协会《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》，长城基金管理有限公司（以下简称本管理人）自2008年9月16日始，对旗下基金所持符合条件的长期停牌股票采用指数收益法进行估值（详见本管理人2008年9月16日的有关公告）。

根据上述公告及中国证券投资基金业协会《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》等文件，经与托管行协商一致，自2015年9月1日起，本管理人对旗下基金所持股票江苏三友（002044）按指数收益法进行估值。

待上述股票复牌且交易体现活跃市场交易特征后，本管理人将恢复按市价估值方法进行估值，届时不再另行公告。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

长城基金管理有限公司网站：www.ccfund.com.cn

客户服务电话：400－8868－666

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，并注意投资风险。

特此公告

长城基金管理有限公司
二〇一五年九月二日

华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信期货有限公司为代销机构并开通定期定额投资和转换业务的公告

根据华润元大基金管理有限公司（以下简称"本公司"）与中信期货有限公司（以下简称"中信期货"）签署的证券投资基金销售协议的相关规定，自2015年9月7日起，本公司旗下部分基金增加中信期货为代销机构，同时开通基金定期定额投资业务（以下简称"定投业务"）和基金转换业务，现将有关事宜公告如下：

一、关于增加中信期货为代销机构，同时开通基金定投业务和基金转换业务

（一）适用基金范围与代码

华润元大富时中国A50指数型证券投资基金（基金代码：000835）
华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：000273）
华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金（基金代码：000646）
华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金（基金代码：000522）
华润元大现金收益货币市场基金（基金代码：000324（A类）000325（B类））

（二）关于增加中信期货为代销机构

自2015年9月7日起，投资者均可在中信期货办理上述基金的开户、申购等业务。具体办理分别以中信期货的相关业务规定为准。

（三）关于基金定投业务

基金定投业务是指投资者通过向有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。基金定投业务并不构成对基金日常申购、赎回等业务的影响，投资者在办理相关基金定期定额投资业务的同时，仍然可以进行日常申购、赎回业务。投资者定期定额申购上述开放式基金的单次申购金额最低限额为人民币100元，具体以销售机构的业务规则为准。

（四）关于基金转换业务

1、转换业务办理场所和时间

（1）投资者可以通过中信期货办理本公司旗下上述指定开放式基金的转换业务。

（2）投资者可在基金开放日申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间相同(本公司公告暂停基金转换时除外)。

2、转换费率

投资者申请办理本公司旗下上述指定开放式基金的转换业务时，转换费率将按照转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取。当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时，费用补差为按照转出基金金额计算的申购费用差额；当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，不收取费用补差。

3、基金转换申请人的范围

已持有本公司管理的上述指定开放式基金中任一只基金的个人投资者、机构投资者以及合格的境外机构投资者。

4、基金转换份额的计算

（1）非货币基金之间的转换

计算公式：

转出确认金额＝转出份额×转出基金份额净值
赎回费＝转出确认金额×赎回费率
补差费＝(转出确认金额–赎回费)×补差费率÷(1+补差费率)
转入确认金额＝转出确认金额－赎回费－补差费
转入确认份额＝转入确认金额÷转入基金份额净值
（若转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，补差费为零）

（2）货币基金转至非货币基金之间的转换

计算公式：

转出确认金额＝转出份额×转出基金份额净值＋转出份额对应的未结转收益
补差费＝转出份额×转出基金份额净值×补差费率÷(1＋补差费率)
转入确认金额＝转出确认金额－补差费
转入确认份额＝转入确认金额÷转入基金份额净值
(货币基金份额净值为1.00元，没有赎回费)

5、基金转换的注册登记

投资者申请基金转换成功后，基金注册登记机构在T＋1工作日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续，一般情况下，投资者自T＋2工作日起可赎回转入部分的基金份额。

6、转换最低份额限制

单笔转换起点份额为100份（具体以销售机构的业务规则为准）。基金持有人可将其全部或部分基金份额转换成其它基金，单笔转换申请不受转入基金最低申购限额限制。

7、其他需要提示的事项

基金转换只能在同一销售机构进行。进行转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记人处注册登记的基金。投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态。

二、投资者可以通过以下途径了解或咨询有关事宜

1、中信期货销售网站：www.citicsf.com

中信期货客户服务电话：0755－23953913

2、华润元大基金管理有限公司网站：www.cryuantafund.com

华润元大基金管理有限公司全国统一客户服务电话：4000－1000－89

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。

投资者投资于本公司管理的基金前时应认真阅读基金的基金合同、招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

本公告的解释权归华润元大基金管理有限公司。

特此公告。

华润元大基金管理有限公司
2015年9月2日