(上接B69版)

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	3,840,000.00	0.19
B	采矿业	–	–
C	制造业	93,216,809.31	4.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	5,253,000.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,543,000.00	0.07
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,875,608.57	2.56
J	金融业	39,809,400.00	1.93
K	房地产业	8,514,900.00	0.41
L	租赁和商务服务业	26,352,326.00	1.28
M	科学研究和技术服务业	756,000.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	1,139,400.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	3,092,645.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	11,041,200.00	0.53
S	综合	–	–
	合计	247,434,288.88	11.98

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	600016	民生银行	3,010,000	29,919,400.00	1.45
2	600654	中安消	524,000	16,196,840.00	0.78
3	000062	深圳华强	223,400	12,749,438.00	0.62
4	000061	农产品	500,000	10,200,000.00	0.49
5	002180	艾派克	200,000	8,800,000.00	0.43
6	002268	卫士通	100,000	8,014,000.00	0.39
7	300075	数字政通	149,953	5,651,728.57	0.27
8	002348	高乐股份	350,000	5,470,500.00	0.26
9	002030	达安基因	120,000	5,316,000.00	0.26
10	600153	建发股份	300,000	5,253,000.00	0.25

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	747,880,000.00	36.20
	其中:政策性金融债	747,880,000.00	36.20
4	企业债券	56,625,531.70	2.74
5	企业短期融资券	977,299,000.00	47.30
6	中期票据	482,048,000.00	23.33
7	可转债	374,899.80	0.02
8	可交换债	4,747,153.10	0.23
9	其他	–	–
10	合计	2,268,974,584.60	109.82

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	150205	15国开05	2,700,000	263,169,000.00	12.74
2	101553006	15铁道MTN001	1,700,000	174,403,000.00	8.44
3	011570004	15赣高速SCP004	1,200,000	120,588,000.00	5.84
4	101453021	14粤城建MTN001	1,100,000	115,027,000.00	5.57
5	150210	15国开10	1,000,000	100,930,000.00	4.88

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

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	242,219.75
2	应收证券清算款	51,906,444.17
3	应收股利	–
4	应收利息	39,369,827.82
5	应收申购款	3,264,362.90
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	94,782,854.64

(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

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	600654	中安消	16,196,840.00	0.78	重大事项
2	002268	卫士通	8,014,000.00	0.39	重大事项
3	002348	高乐股份	5,470,500.00	0.26	重大事项
4	600153	建发股份	5,253,000.00	0.25	重大事项

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

1)、本基金本报告期末未持有处于交换期的可交换债券。

2)、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。

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

	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	4.18%	0.72%	2.41%	0.28%	1.77%	0.44%
	2015年度上半年	11.22%	0.68%	3.77%	0.24%	7.45%	0.44%
	2014年度	32.31%	0.58%	10.55%	0.16%	21.76%	0.42%
	2013年度	4.19%	0.68%	-3.95%	0.17%	8.14%	0.51%
	2012年度	9.37%	0.40%	1.25%	0.13%	8.12%	0.27%
	2011年度(自基金合同生效日起至2011年12月31日)	0.80%	0.28%	1.72%	0.17%	-0.92%	0.11%
C类	过去三个月	4.00%	0.72%	2.41%	0.28%	1.59%	0.44%
	2015年度上半年	10.97%	0.67%	3.77%	0.24%	7.20%	0.43%
	2014年度	31.72%	0.57%	10.55%	0.16%	21.17%	0.41%
	2013年度	3.85%	0.68%	-3.95%	0.17%	7.80%	0.51%
	2012年度	8.66%	0.40%	1.25%	0.13%	7.41%	0.27%
	2011年度(自基金合同生效日起至2011年12月31日)	0.70%	0.28%	1.72%	0.17%	-1.02%	0.11%

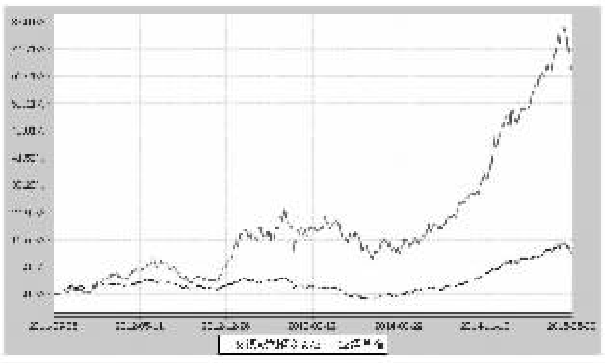
2.自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德双利债券证券投资基金

份额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

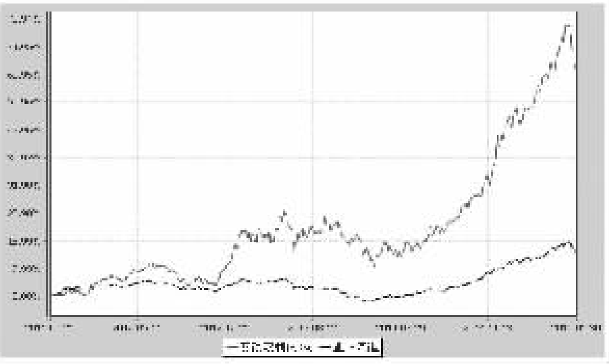
(2011年9月26日至2015年6月30日)

1. 交银双利债券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. 交银双利债券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有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.证券账户开户费用和银行账户维护费;

10.依法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

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为0.7%

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,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.2%

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)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

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。

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。

(4)除管理费、托管费和C类基金份额销售服务费之外的基金费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,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。

投资人可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。

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:

持有期限	B类基金份额后端申购费率
1年以内(含)	1.0%
1年—3年(含)	0.6%
3年—5年(含)	0.4%
5年以上	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。

本基金自2013年4月11日起,对通过本公司直销柜台申购本基金A类基金份额的养老金客户实施特定申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,具体包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,本公司将发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。

通过本公司直销柜台申购本基金A类基金份额的养老金客户特定申购费率如下表:

	申购金额(含申购费)	特定申购费率
特定申购费率(A类基金份额)	50万元以下	0.32%
	50万元(含)至100万元	0.18%
	100万元(含)至200万元	0.10%
	200万元(含)至500万元	0.06%
	500万元以上(含500万)	每笔交易1000元

有关养老金客户实施特定申购费率的具体规定以及活动时间如有变化,敬请投资人留意本公司发布的相关公告。

(2)申购份额的计算

(a)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)

(注:对于适用固定金额申购费用的申购,净申购金额=申购总金额—固定申购费用金额)

申购费用=申购总金额–净申购金额

(注:对于适用固定金额申购费用的申购,申购费用=固定申购费用金额)

例一:某投资人投资100,000元申购本基金的A类基金份额(非网上交易),假设申购当日A/B类基金份额净值为1.040元,申购费率为0.8%,如果该投资人是场外申购,则其可得到的申购份额为:

申购总金额=100,000元

净申购金额=100,000/(1+0.8%)=99,206.35元

申购费用=100,000−99,206.35=793.65元

申购份额=(100,000−793.65)/1.040=95,390.72份

如果该投资人是场内申购,申购份额为95,390份,其余0.72份对应金额返回给投资人。

(b)B类基金份额的申购

申购总金额=申请总金额

当投资人提出赎回时,后端申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100,000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1.040元,则其可得到的申购份额为:

申购份额=100,000/1.040=96,153.85份

即:投资人投资100,000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1.040元,则可得到96,153.85份基金份额,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。

(c)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100,000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1.040元,则其可得到的申购份额为:

申购份额=100,000/1.040=96,153.85份

即:投资人投资100,000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1.040元,则其可得到96,153.85份C类基金份额。

(3)赎回费

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,其余用于支付注册登记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	赎回费率
1年以内(含)	0.1%
1年—2年(含)	0.05%
2年以上	0

(4)赎回金额的计算

(a)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

例四:某投资人赎回100,000份A类基金份额,对应的赎回费率为0.1%,假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.016元,则其可得到的赎回金额为:

赎回费用=100,000×1.016×0.1%=101.60元

赎回金额=100,000×1.016−101.60=101,498.40元

即:投资人赎回100,000份A类基金份额,假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.016元,则其可得到的赎回金额为101,498.40元。

(b)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

例五:某投资人赎回100,000份B类基金份额,对应的后端申购费率是1.0%,赎回费率为0.1%,假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.016元,申购时的A/B类基金份额净值为1.010元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总额=100,000×1.016=101,600元

后端申购费用=100,000×1.010×1.0%=1,010.00元

赎回费用=101,600×0.1%=101.60元

赎回金额=101,600−1,010.00−101.60=100,488.40元

即:投资人赎回100,000份B类基金份额,对应的赎回费率为0.1%,假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.016元,投资人对应的后端申购费率是1.0%,申购时的A/B类基金份额净值为1.010元,则其可得到的赎回金额为100,488.40元。

(c)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

例六:某投资人赎回100,000份C类基金份额,假设赎回当日C类基金份额净值是1.250 元,则其可得到的赎回金额为:

赎回金额=100,000×1.250=125,000 元

即:投资人赎回100,000份C类基金份额,假设赎回当日C类基金份额净值是1.250元,则其可得到的赎回金额为125,000元。

(5)转换费

(a)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。

(b)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。

(c)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。

(d)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。

(e)"网上直销交易平台"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。

(f)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。

(6)基金转换份额的计算公式

(a)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

(b)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

(7)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。本公司暂不开展网上直销本基金B类基金份额的认/申购业务,通过转托管转入网上直销账户的本基金B类基金份额只能办理赎回业务。通过网上直销交易平台办理本基金A类基金份额申购和定期定额投资业务的个人投资者将享受前端申购费率优惠,通过网上直销交易平台进行基金转换,从各基金招募说明书所载的零申购费率的基金转入非零申购费率的基金,转出与转入基金的前端申购补差费率将享受优惠,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交易平台申购、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A类、C类基金份额的单笔最低金额为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。

(8)基金管理人可以在履行相关手续后,在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式,基金管理人应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(9)基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和转换费率。

(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、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(四)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

(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

本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

(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"八、基金份额的申购与赎回"中相关内容。

(六)更新了"十、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。

(七)更新了"十一、基金的业绩"中相关内容,数据截止到2015年6月30日。

(八)更新了"二十一、托管协议的内容摘要"中相关内容。

(九)更新了"二十三、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○一五年十一月十日

(上接B70版)

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

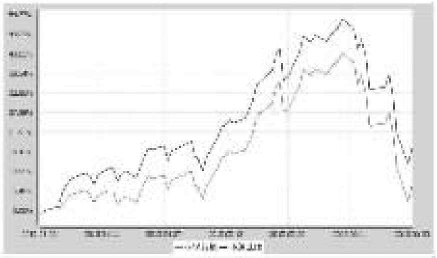
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.29%	3.00%	16.80%	2.87%	-9.51%	0.13%
自基金合同生效起至今	7.50%	2.90%	18.09%	2.79%	-10.59%	0.11%

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

交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年3月26日至2015年6月30日)



注:本基金基金合同生效日为2015年3月26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。

十五、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、基金标的指数许可使用费;

4、基金上市初费及上市年费;

5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

7、基金份额持有人大会费用;

8、基金的证券、期货交易费用;

9、基金的银行汇划费用;

10、基金的开户费用、账户维护费用;

11、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1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.0%÷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

自基金合同生效日起,基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。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。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(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0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.22%÷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

自基金合同生效日起,基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。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。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(3)标的指数许可使用费

本基金作为指数基金,需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付标的指数许可使用费。本基金标的指数许可使用费年费率为0.02%,基金合同生效之日所在季度的标的指数许可使用费,按实际计提金额收取,不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起,标的指数许可使用费的收取下限为每季度5万元,若季度不足5万元时按照5万元收取。标的指数许可使用费在通常情况下按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×0.02%÷当年天数

H为每日应计提的基金标的指数许可使用费

E为前一日基金资产净值

自基金合同生效日起,基金标的指数许可使用费每日计提,按季支付,由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令,经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付,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。

如果标的指数供应商根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计费方式,本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

(4)上述"(一)基金费用的种类"中第4—11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。

2、与基金销售有关的费用

(1)申购费

交银新能源份额的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

投资人可以多次申购本基金,申购费用按每笔申购申请单独计算。

场外申购分为前端收费模式和后端收费模式,前端收费模式是指在投资者申购基金份额时收取前端申购费用、赎回时收取赎回费用,后端收费模式是在投资者申购时不收取申购费用、赎回时收取后端申购费用和赎回费用。本基金开放办理申购赎回业务时开通前端收费模式。本基金管理人并可视业务情况择时增开后端收费模式。

本基金的场外前端申购费率如下:

申购金额(含申购费)	场外前端申购费率
50万元以下	1.2%
50万元(含)至100万元	0.8%
100万元(含)至200万元	0.6%
200万元(含)至500万元	0.4%
500万元以上(含500万)	每笔交易1000元

如本基金开通后端收费模式后,其申购费率如下:

持有期限	场外后端申购费率
1年以内(含)	1.4%
1年—3年(含)	1.0%
3年—5年(含)	0.5%
5年以上	0

上表中的"年"指的是365个自然日。

本基金的场内申购只能选择前端收费模式支付申购费用。本基金的场内申购费率由场内销售机构参照上表场外前端申购费率设定。

因红利自动再投资而产生的基金份额,不收取相应的申购费用。

本基金对通过基金管理人直销柜台申购交银新能源份额的养老金客户实施特定申购费率,且只适用前端收费模式。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,具体包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,本公司将发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。

通过基金管理人直销柜台申购本基金的养老金客户特定场外前端申购费率如下表:

申购金额(含申购费)	特定场外前端申购费率
50万元以下	0.24%
50万元(含)至100万元	0.16%
100万元(含)至200万元	0.12%
200万元(含)至500万元	0.08%
500万元以上(含500万)	每笔交易1000元

(2)赎回费

交银新能源份额的赎回费用由赎回份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取,赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金的场外赎回费率如下:

持有期限	场外赎回费率
1年以内(含)	0.5%
1年—2年(含)	0.2%
2年以上	0

上表中的"年"指的是365个自然日。场外赎回交银新能源份额时,其持有期限的计算以中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则为准。

本基金的场内赎回费率为固定值0.5%,不按份额持有时间分段设置赎回费率。

(3)基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(4)基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资人定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对投资人适当调低基金申购费率和赎回费率。

(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)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、基金托管费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率,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。

十六、基金份额的折算

(一)基金份额定期折算

交银新能源A份额、交银新能源份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的第一个工作日,本基金将按照以下规则进行基金份额的定期折算。

1、基金份额定期折算基准日

每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的第一个工作日。

但基金合同生效日至第1个定期折算基准日不足6个月的,则该年度可不进行定期折算;定期折算基准日前3个月内发生过不定期折算的,则该年度可不进行定期折算。若基金管理人在前述情况下决定不进行定期折算,基金管理人应在基金份额定期折算基准日前至少提前2日在指定媒介上公告不进行定期折算的提示性公告。

2、基金份额定期折算的对象

基金份额定期折算基准日登记在册的交银新能源A份额、交银新能源份额。

3、基金份额定期折算频率

每个会计年度进行1次(可不进行定期折算的情形除外)。

4、基金份额定期折算方式

(1)在每个基金份额定期折算基准日,本基金将对当日登记在册的交银新能源A份额进行应得收益的定期份额折算,交银新能源份额的基金份额净值也相应的进行调整。在基金份额折算前与折算后,交银新能源A份额和交银新能源B份额的份额配比保持1:1的比例。

(2)折算前的交银新能源A份额持有人,以交银新能源A份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出1.000元部分,获得新增场内交银新能源份额的份额分配。交银新能源A份额持有人持有的交银新能源A份额的基金份额参考净值折算调整为1.000元、份额数量不变,相应折算增加场内交银新能源份额。

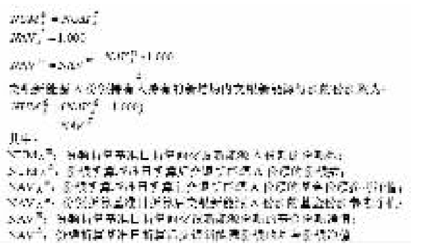
(3)折算前的交银新能源份额持有人,以每2份交银新能源份额配比1份交银新能源A份额进行份额分配,获得新增交银新能源份额。持有场外交银新能源份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外交银新能源份额的分配;持有场内交银新能源份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内交银新能源份额的分配。

(4)折算不改变交银新能源B份额持有人的资产净值,其持有的交银新能源B份额的基金份额参考净值及份额数量不变。

按照上述折算方法,由于计算过程尾差处理的原因,可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差,该误差归入基金财产,视为未改变基金份额持有人的资产净值。

5、基金份额定期折算公式

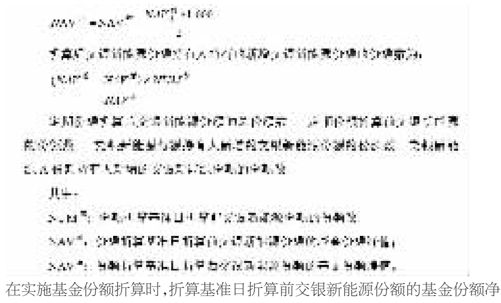
(1)交银新能源A份额



(2)交银新能源B份额

每个会计年度的定期份额折算不改变交银新能源B份额的基金份额参考净值及其份额数。

(3)交银新能源份额



在实施基金份额折算时,折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源A份额的基金份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6、基金份额定期折算期间的基金业务办理

为保证基金份额定期折算期间的平稳运作,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交银新能源A份额与交银新能源B份额的上市交易、交银新能源份额的申购或赎回及场内份额配对转换等相关业务,具体见基金管理人届时发布的相关公告。

7、基金份额定期折算结果的公告

基金份额定期折算结束后,基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介上公告,并报中国证监会备案。

(二)基金份额不定期折算

除以上定期份额折算外,本基金还将在交银新能源份额的基金份额净值大于或等于1.500元或交银新能源B份额的基金份额参考净值小于或等于0.250元时进行不定期份额折算。

1、交银新能源份额的基金份额净值大于或等于1.500元时的不定期折算

(1)基金份额不定期折算基准日

如果某个工作日交银新能源份额的基金份额净值大于或等于1.500元,基金管理人可根据市场情况确定不定期折算基准日。不定期折算基准日的具体日期,详见基金管理人届时发布的公告。

(2)基金份额不定期折算的对象

基金份额不定期折算基准日登记在册的交银新能源A份额、交银新能源B份额、交银新能源份额。

(3)基金份额不定期折算频率

不定期。

(4)基金份额不定期折算方式

1)折算前的交银新能源份额持有人,获得新增交银新能源份额的份额分配。交银新能源份额持有人持有的交银新能源份额的基金份额净值折算调整为1.000元,份额数量相应折算增加;

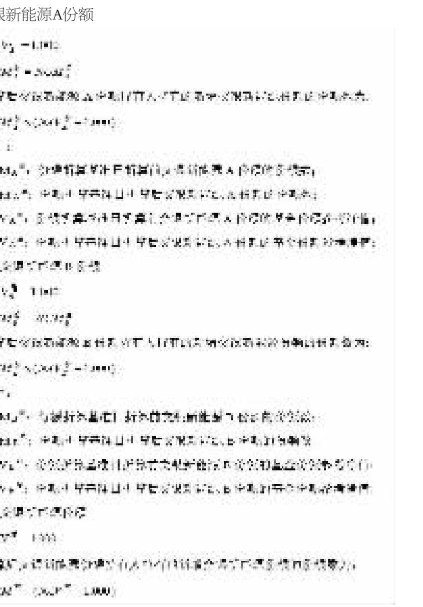
2)折算前的交银新能源A份额持有人,以交银新能源A份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出1.000元部分,获得新增场内交银新能源份额的份额分配。交银新能源A份额持有人持有的交银新能源A份额净值折算调整为1.000元、份额数量不变,相应折算增加场内交银新能源份额;

3)折算前的交银新能源B份额持有人,以交银新能源B份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出1.000元部分,获得新增场内交银新能源份额的份额分配。交银新能源B份额持有人持有的交银新能源B份额净值折算调整为1.000元、份额数量不变,相应折算增加场内交银新能源份额。

按照上述折算方法,由于计算过程尾差处理的原因,可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差,该误差归入基金财产,视为未改变基金份额持有人的资产净值。

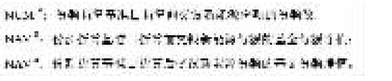
(5)基金份额折算公式

1)交银新能源A份额



折算后交银新能源份额的总份额数=折算前交银新能源份额的份额数+交银新能源份额持有人新增的交银新能源份额数+交银新能源A份额持有人新增的场内交银新能源份额数+交银新能源B份额持有人新增的场内银新能源份额数

其中:



在实施基金份额折算时,折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源A份额和交银新能源B份额的基金份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

2、交银新能源B份额的基金份额参考净值小于或等于0.250元时的不定期折算

(1)基金份额不定期折算基准日

如果某个工作日交银新能源B份额的基金份额参考净值小于或等于0.250元,基金管理人可根据市场情况确定不定期折算基准日。不定期折算基准日的具体日期,详见基金管理人届时发布的公告。

(2)基金份额不定期折算的对象

基金份额不定期折算基准日登记在册的交银新能源A份额、交银新能源B份额、交银新能源份额。

(3)基金份额不定期折算频率

不定期。

(4)基金份额不定期折算方式

1)交银新能源份额持有人持有的交银新能源份额的基金份额净值折算调整为1.000元、份额数量相应折算调整;

2)交银新能源A份额持有人持有的交银新能源A份额的基金份额参考净值折算调整为1.000元、份额数量相应折算调整,相应折算增加交银新能源份额;

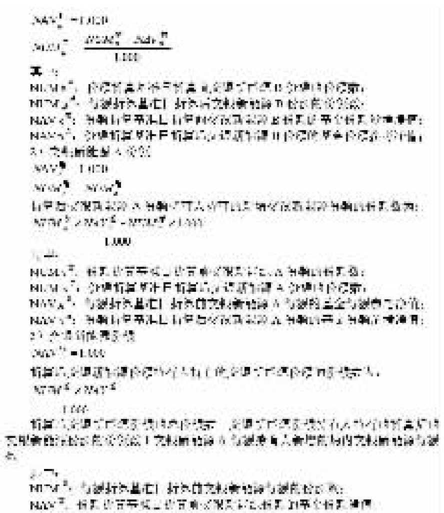
3)折算不改变交银新能源B份额持有人的资产净值,其持有的交银新能源B份额的基金份额参考净值折算调整为1.000元、份额数量相应折算调整;

4)交银新能源A份额与交银新能源B份额的基金份额配比保持1:1的比例不变。

按照上述折算方法,由于计算过程尾差处理的原因,可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差,该误差归入基金财产,视为未改变基金份额持有人的资产净值。

(5)基金份额折算公式

1)交银新能源B份额



在实施基金份额折算时,折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源A份额和交银新能源B份额的基金份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

3、折算份额数的处理方式

上述定期或不定期折算后,场外份额的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产计入基金财产;场内份额的份额数取整计算(最小单位为1份),小数点以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产计入基金财产。

4、基金份额不定期折算期间的基金业务办理

为保证基金份额不定期折算期间的平稳运作,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交银新能源A份额与交银新能源B份额的上市交易、交银新能源份额的申购或赎回及场内份额配对转换等相关业务,具体见基金管理人届时发布的相关公告。

5、基金份额不定期折算结果的公告

基金份额不定期折算结束后,基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介上公告,并报中国证监会备案。

(三)特殊情况的处理

若在某一个会计年度的定期份额折算基准日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时,基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则,根据具体情况选择按照定期份额折算规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算,具体以基金管理人届时发布的公告为准。

基金合同生效日至第1个定期折算基准日不足6个月的,则该年度可不进行定期折算。

定期折算基准日前3个月内发生过不定期折算的,则该年度可不进行定期折算。若基金管理人在前述情况下决定不进行定期折算,基金管理人应在基金份额定期折算基准日前至少提前2日在指定媒介上公告不进行定期折算的提示性公告。

(四)基金管理人、深圳证券交易所、登记机构有权调整上述规则,本基金《基金合同》将视需要进行相应修改,且此项修改无须召开基金份额持有人大会,并在本基金更新的招募说明书中列示。

十七、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"七、基金的募集"中相关内容。

(六)更新了"八、基金合同的生效"中相关内容。

(七)更新了"九、交银新能源A份额和交银新能源B份额的上市交易"中相关内容。

(八)更新了"十、交银新能源份额的申购与赎回"中相关内容。

(九)更新了"十二、场内份额的配对转换"中相关内容。

(十)更新了"十三、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。

(十一)更新了"十四、基金的业绩"中相关内容,数据截止到2015年6月30日。

(十二)更新了"十六、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。

(十三)更新了"二十五、托管协议的内容摘要"中相关内容。

(十四)更新了"二十六、对基金份额持有人的服务"中相关内容。

(十五)更新了"二十七、其他应披露事项"中的相关内容。

交银施罗德基金管理有限公司
二○一五年十一月十日