# 交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金(更新)招募说明书摘要

（2015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

二〇一五年十二月

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】**

交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2014年10月24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【2014】1116号文准予募集注册。本基金基金合同于2014年12月15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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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。

本基金在基金合同生效之日起两年(含两年)的期间内采取封闭式运作，按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的情形除外。封闭期内，基金投资者不能申购、赎回本基金基金份额。本基金转入开放期后基金投资者方可申购、赎回本基金基金份额。

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，自主判断基金的投资价值，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：因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险；流动性风险；交易对手违约风险；基金资产净值连续二十个工作日低于1亿元时基金管理人可依基金合同约定提前终止基金合同的风险；投资本基金特有的其他风险等等。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。

投资有风险，投资人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等信息披露文件。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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。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2015年12月15日，有关财务数据和净值表现截止日为2015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：上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼
邮政编码：200120
法定代表人：于亚利
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：何万金
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

于亚利女士，董事长，硕士学位。现任交通银行执行董事、副行长。历任交通银行郑州分行财务会计处处长、郑州分行副行长，交通银行财务会计部副总经理、总经理，交通银行预算财务部总经理、交通银行首席财务官。

雷贤达先生，副董事长，学士学位，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。

阮红女士，董事，总经理，博士学位，兼任交银施罗德资产管理有限公司董事长。历任交通银行办公室副处长、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，交通银行投资管理部总经理。

陶文先生，董事，硕士学位。现任交通银行个人金融业务部总经理。历任交通银行徐州分行副行长、行长，交通银行南京分行副行长，交通银行海南分行行长。

孙培基先生，董事，学士学位。现任交通银行风险管理部副总经理。历任交通银行财会部副处长，交通银行董事会办公室副处长、处长，交通银行预算财务部高级经理，交通银行海南分行副行长，交通银行审计部副总经理。

孟方德先生，董事，硕士学位。现任施罗德投资管理有限公司亚太区总裁。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。

谢丹阳先生，独立董事，博士学位。现任武汉大学经济与管理学院院长、香港科技大学经济系教授。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、瑞安经管中心主任。

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

周林先生，独立董事，博士学位。现任上海交通大学安泰经济与管理学院院长、教授。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。

2、基金管理人监事会成员

王忆军先生，监事长，硕士学位。现任交通银行战略投资部总经理。历任交通银行办公室副处长，交通银行公司业务部副处长、高级经理、总经理助理、副总经理，交通银行投资银行部副总经理，交通银行江苏分行副行长。

裴关淑仪女士，监事，双硕士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司助理总经理、交银施罗德资产管理（香港）有限公司总经理。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。

张丽女士，监事，硕士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司投资运营部总经理，历任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)高级审计员，交银施罗德基金管理有限公司基金运营部高级基金会计、部门总经理助理、副总经理、总经理。

张玲蕾女士，监事，学士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司营销管理部总经理。历任中国银行福州分行客户经理，新华人寿保险公司上海分公司区域经理，银河基金管理有限公司市场部渠道经理，交银施罗德基金管理有限公司渠道经理、渠道部副总经理、广州分公司副总经理。

3、基金管理人高级管理人员

阮红女士，总经理。简历同上。

许珊燕女士，副总经理，硕士学历，高级经济师，兼任交银施罗德资产管理有限公司董事。历任湖南大学(原湖南财经学院)金融学院讲师，湖财证券有限责任公司国债部副经理、基金管理总部总经理，湖财荷银基金管理有限公司副总经理。

夏华龙先生，副总经理，博士学历。历任中国地质大学经济管理系教师、经济学院教研室副主任、主任、经济学院副院长；交通银行资产托管部副处长、处长、高级经理、副总经理；云南省曲靖市市委常委、副市长（挂职）。

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。

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评购高级经理，交银施罗德基金管理有限公司综合管理部总监。

乔宏军先生，副总经理，博士学历，高级经济师，兼任交银施罗德资产管理有限公司董事、总经理。历任交通银行资金部副处长、副高级经理、高级经理；交通银行金融市场部高级经理、总经理助理、副总经理；交通银行金融市场业务中心副总裁。

4、本基金基金经理

孙超先生，基金经理。中国人民大学学士，美国哥伦比亚大学硕士。4年证券从业经验。2011年7月至2013年6月曾任中信建投证券股份有限公司资产管理部经理、高级经理。2013年加入交银施罗德基金管理有限公司，自2013年7月8日至2014年6月30日担任交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金经理助理，2013年7月8日至2014年8月25日担任交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金经理助理，2013年7月8日至2014年8月25日担任交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理助理，2014年7月1日至2014年8月25日担任交银施罗德强化回报债券型证券投资基金基金经理助理。2014年8月26日至2015年11月18日担任交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金经理，2014年8月26日至2015年11月18日担任交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理，2014年8月26日起担任交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金经理至今，2014年8月26日起担任交银施罗德强化回报债券型证券投资基金基金经理至今，2014年12月15日起担任交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金基金经理至今，2015年1月19日起担任交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金基金经理至今，2015年1月30日起担任交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金基金经理至今，2015年5月9日起担任交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金经理至今。2015年7月18日起担任交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理至今，2015年11月7日起担任交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金和交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金经理至今，2015年11月9日起担任交银施罗德丰硕债券型证券投资基金基金经理至今。

连端清先生，基金经理。复旦大学经济学博士。7年金融行业从业经验。2009年至2011年于交通银行总行金融市场部任职，2011年至2013年任湘财证券研究所研究员，2013年至2015年任中航信托资产管理部投资经理。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。2015年8月4日起担任交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金、交银施罗德现金宝货币市场基金、交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金的基金经理至今，2015年10月16日起担任交银施罗德货币市场证券投资基金、交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金经理至今。

5、投资决策委员会成员

委员：阮红（总经理）
乔宏军（副总经理）
王少成（权益投资总监、基金经理）
张鸿羽（研究部总经理）
齐晗（跨境投资总监、投资经理）

上述人员之间无近亲属关系。上述各项人员信息更新截止日为2015年12月15日，期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

**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9号东方文化大厦北楼
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：010-89936330
传真：010-85230024
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，并以屡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

李庆萍，行长，高级经济师。1984年8月至2007年1月，任中国农业银行总行国际业务部干部、副处长、处长、副总经理、总经理。2007年1月至2008年12月，任中国农业银行广西分行党委书记、行长。2009年1月至2009年5月，任中国农业银行零售业务总监兼个人业务部、个人信贷业务部总经理。2009年5月至2013年9月，任中国农业银行总行零售业务总监兼个人金融部总经理。2013年9月至2014年7月，任中国中信股份有限公司副总经理。2014年7月，任中国中信股份有限公司副总经理、中信银行行长。

杨毓先生，中信银行副行长，分管托管业务。1962年12月生，2011年4月起担任中国建设银行江苏省分行行长，党委书记；2006年7月至2011年3月担任中国建设银行河北省分行行长，党委书记；1982年8月至2006年7月在中国建设银行河南省分行工作，历任计划财务处科员、副处长，信阳地区中心支行副行长，党组成员，计划处处长，中介处处长，郑州市铁路专业支行行长，党组书记，郑州分行行长，党委书记，金水支行行长，党委书记，河南省分行副行长，党委副书记。

刘泽云先生，现任中信银行股份有限公司资产托管部总经理，经济学博士。1996年8月进入本行工作，历任总行行长秘书室科长、总行投资银行部处经理、总行资产保全部主管、总行国际业务部总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）。

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2015年6月30日，中信银行已托管63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，托管总规模突破4万亿元人民币。

（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控制管委员会，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基金管理人以及本基金管理人的网上直销交易平台。

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：上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼
法定代表人：于亚利
成立时间：2005年8月4日
电话：（021）61055724
传真：（021）61055054
联系人：傅鲸
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基金管理人网上直销交易平台办理开户等业务，具体交易细则请参阅基金管理人网站。网上直销交易平台网址：www.fund001.com，www.bocomschroder.com。

2、除基金管理人之外的其他销售机构

（1）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

（2）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9号东方文化大厦北楼
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

（3）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：王常青
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

（4）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

（5）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

（6）国都证券股份有限公司
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

（7）中信证券（山东）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

（8）中泰证券股份有限公司
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

（9）江海证券有限公司
住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
电话：（0451）85863719
传真：（0451）82287211
联系人：刘爽
客户服务电话：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

（10）长城国瑞证券有限公司
住所：厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼
办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼
法定代表人：王勇
电话：（0592）5161642
传真：（0592）5161640
联系人：赵钦
客户服务电话：（0592）5163588
网址：www.xmzq.cn

（11）中国国际金融股份有限公司
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：丁学东
电话：（010）65051166
传真：（010）85679203
联系人：杨涵宇
网址：www.cicc.com.cn

（12）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

（13）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：王春峰
电话：（022）28451991
传真：（022）28451892
联系人：蔡霆
客户服务电话：400-651-5988
网址：www.bhzq.com

（14）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

（15）西南证券股份有限公司
住所：重庆市江北区桥北苑8号
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：余维佳
电话：（023）63786141
传真：（023）63786212
联系人：张煜
客户服务电话：400-809-6096
网址：www.swsc.com.cn

（16）华龙证券有限责任公司
住所：兰州市城关区东岗西路638号财富中心
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富中心
法定代表人：李晓安
电话：（0931）4890208
传真：（0931）4890628
联系人：李昕田
客户服务电话：4006898888、（0931）4890208
网址：www.hlzqgs.com

（17）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：北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人：林义相
电话：（010）66045529
传真：（010）66045518
联系人：尹伶
客户服务电话：（010）66045678
网址：http://www.txsec.com，www.jjm.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：周明
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：俞卫锋
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：钟睿
经办律师：黎明、孙睿

（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
执行事务合伙人：李丹
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：沈兆杰
经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

**四、基金的名称**

本基金名称：交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金

**五、基金的类型**

本基金类型：契约型债券型基金。本基金在基金合同生效之日起两年(含两年)的期间内封闭式运作（按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外），封闭期结束后转为开放式运作。基金存续期间为不定期。

**六、基金的投资目标**

在严格控制风险的基础上，力求获得高于业绩基准的投资收益。

**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，包括国内依法发行交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、分离交易可转债的纯债、次级债、资产支持证券、短期融资券、中期票据、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产和法律法规允许投资的其他金融工具。其中，封闭期内，本基金所投企业债和公司债信用评级需在AA级（含）以上。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。同时本基金不参与可转换债券投资（分离交易可转债的纯债部分除外）。

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。

基金的投资组合比例为投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但在封闭期结束前三个月和转开放后三个月内，基金投资不受上述债券资产投资比例限制。

本基金在开放期内，现金或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%。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

**八、基金的投资策略**

1、封闭期内的投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，融合规范化的基本面研究和严谨的信用分析，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，充分利用封闭式运作优势，以买入持有和杠杆套息等为基本投资策略，获取稳定收益；同时，本基金将严格控制信用风险，在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上精选个券。本基金采用的主要策略包括：

（1）债券的类属配置策略

（下转B118版）

# 交银施罗德基金管理有限公司关于调整交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金B类份额折算基准日证券简称的公告

截至2016年1月28日，交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金B类份额（证券简称：E金融B；证券编码：150318）的基金份额参考净值为0.210元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件，根据基金合同的约定，将以2016年1月29日作为基金份额折算日办理不定期份额折算业务。

为加强折算日交易风险提示，经向深圳证券交易所申请，2016年1月29日交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金B类份额证券简称前将冠以“*”标识，即证券简称由“E金融B”调整为“*E金融B”，并自2016年2月1日起恢复原证券简称，即证券简称由“*E金融B”恢复为“E金融B”，证券编码保持不变。届时不再另行公告，敬请广大投资者们注意。

本基金管理人提请投资者警惕基金风险，切勿盲目投资。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一六年一月二十九日

# 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金B类份额不定期份额折算期间的风险提示公告

根据《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）中关于不定期份额折算的相关约定，当交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之交银互联网金融B份额（场内简称：E金融B，代码：150318）的基金份额参考净值跌至0.250元或以下时，本基金将进行不定期份额折算。

截至2016年1月28日，本基金交银互联网金融B份额的基金份额参考净值为0.210元，达到基金合同约定的不定期份额折算条件。根据基金合同的约定，本基金将以2016年1月29日为折算基准日办理本基金的不定期份额折算业务。

截至2016年1月28日，交银互联网金融B份额收盘价为0.284元，溢价率高达35.24%。不定期份额折算后，交银互联网金融B份额杠杆倍数将大幅降低，恢复到初始杠杆水平，交银互联网金融B份额的溢价率可能大幅降低。投资者如果在折算基准日（2016年1月29日）当天盲目投资，可能遭受重大损失，敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一六年一月二十九日

# 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告

根据《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）“第二十一部分 基金份额折算”的相关规定，当交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之交银互联网金融B份额的基金份额参考净值小于或等于0.250元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至2016年1月28日，交银互联网金融B份额的基金份额参考净值为0.210元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以2016年1月29日为不定期折算基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额不定期折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为2016年1月29日。

二、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本基金之基础份额“交银互联网金融份额”（基金代码：164907，场内简称“E金融”）、交银互联网金融A份额（基金代码：150317，场内简称“E金融A”）和交银互联网金融B份额（基金代码：150318，场内简称“E金融B”）。

三、基金份额折算方式

当交银互联网金融B份额的基金份额参考净值小于或等于0.250元，本基金将分别对上述折算对象进行份额折算。折算后，上述折算对象的基金份额参考净值或基金份额净值均调整为1.000元；交银互联网金融A份额和交银互联网金融B份额的份额比例仍为1:1。具体折算方式如下：

1、交银互联网金融份额持有人持有的交银互联网金融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、交银互联网金融A份额持有人持有的交银互联网金融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，相应折算增加交银互联网金融份额；

3、折算不改变交银互联网金融B份额持有人的资产净值，其持有的交银互联网金融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、交银互联网金融A份额与交银互联网金融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。

四、基金份额折算公式

1、交银互联网金融B份额

[illegible]

折算后交银互联网金融A份额持有人持有的新增交银互联网金融份额的份额数为：

[illegible]

折算后交银互联网金融份额的总份额数＝交银互联网金融份额持有人持有的折算后的交银互联网金融份额的份额数＋交银互联网金融A份额持有人新增的场内交银互联网金融份额数

其中：

[illegible]

4、折算份额数的处理方式

上述不定期折算后，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。

5、举例

某投资者持有交银互联网金融份额、交银互联网金融A份额和交银互联网金融B份额分别为100,000份、100,000份和100,000份。在本基金的不定期份额折算基准日，假设三类份额的基金份额（参考）净值如下表所示（为便于投资者理解，此处采用假设的净值进行计算），折算后，交银互联网金融份额、交银互联网金融A份额和交银互联网金融B份额的基金份额（参考）净值均调整为1.000元。

| | 折算前 | | 折算后 | |
|---|---|---|---|---|
| | 基金份额(参考)净值(假设值) | 基金份额 | 基金份额(参考)净值 | 基金份额 |
| 交银互联网金融份额 | 0.619元 | 100,000份 | 1.000元 | 61,900份交银互联网金融份额 |
| 交银互联网金融A份额 | 1.028元 | 100,000份 | 1.000元 | 21,000份交银互联网金融A份额＋81,800份交银互联网金融份额 |
| 交银互联网金融B份额 | 0.210元 | 100,000份 | 1.000元 | 21,000份交银互联网金融B份额 |

在实施不定期份额折算时，交银互联网金融A份额、交银互联网金融B份额及交银互联网金融份额折算的具体计算过程及计算结果以基金管理人届时发布的折算结果公告为准。

五、基金份额折算期间的基金业务办理

1、不定期份额折算基准日（即2016年1月29日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管、下同）、份额配对转换业务；交银互联网金融A份额和交银互联网金融B份额将于该日上午9:30-10:30停牌一小时，并于上午10:30复牌；基准日日终，基金管理人将计算当日基金份额净值及份额折算比例。

2、不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即2016年2月1日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、份额配对转换业务；交银互联网金融A份额和交银互联网金融B份额将于该日停牌一天；当日，本基金登记机构及基金管理人将完成份额登记确认及份额折算。

3、不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即2016年2月2日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内的基金份额；交银互联网金融A份额和交银互联网金融B份额将于该日上午9:30-10:30停牌一小时，并于上午10:30之后复牌；自该日起，本基金恢复办理申购、赎回、转托管、份额配对转换业务。

4、根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2016年2月2日交银互联网金融A份额和交银互联网金融B份额即时行情显示的前收盘价为2016年2月1日的交银互联网金融A份额和交银互联网金融B份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元）。

5、2016年2月2日交银互联网金融A份额和交银互联网金融B份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

六、重要提示

1、基金份额风险收益特征变化风险

本基金是一只股票型基金，其预期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，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额，其中交银互联网金融份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银互联网金融A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银互联网金融B份额具有高预期风险、高预期收益的特征。基金管理人并不承诺或保证交银互联网金融A份额的基金份额持有人的约定应得收益，在本基金资产出现极端损失情况下，交银互联网金融A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。投资有风险，敬请投资者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。

2、交银互联网金融B份额表现为高预期风险、高预期收益的特征，当发生基金合同规定的不定期份额折算时，份额折算前交银互联网金融B份额的资产与份额折算后交银互联网金融B份额的资产相等。因此，交银互联网金融B份额持有人的风险收益特征将不发生变化，仍为持有单一的高风险收益特征份额。不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

投资者如果在不定期折算基准日当天追高买入，可能遭受重大损失，敬请投资者注意投资风险。

3、交银互联网金融A份额、交银互联网金融B份额在折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后，其折溢价率可能随之发生较大变化。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。

4、根据基金合同规定，折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日交银互联网金融B份额的基金份额参考净值可能与触发折算的阈值0.250元有一定差异。

5、原交银互联网金融A份额持有人可通过办理份额配对转换业务将此次折算获得的场内交银互联网金融份额分拆为交银互联网金融A份额和交银互联网金融B份额。

6、折算后，本基金交银互联网金融份额的份额数量会发生变化。根据深圳证券交易所