（上接B193版）

电话：（021）61600500
传真：（021）61600602
联系人：蔡小威
客户服务电话：400-021-1010，（021）61600500
网址：www.rffund.com
（105）上海云鸿投资管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层，200127
办公地址：上海市锦康路308号6号楼6层
法定代表人：戴新装
电话：（021）20538888
传真：（021）20538999
联系人：江辉
客户服务电话：400-820-1515
网址：www.zhengtongfunds.com
（106）中证金牛（北京）投资咨询有限公司
住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲一号环球财讯中心A座5层
法定代表人：钱昊旻
电话：（010）59336533
传真：（010）59336500
联系人：孟汉霄
客户服务电话：4008-909-998
网址：www.jnlc.com
（107）乾道金融信息服务（北京）有限公司
住所：北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人：王兴吉
电话：（010）62062880
传真：（010）82057741
联系人：高雪超
客户服务电话：4000-888-080
网址：www.qiandaojr.com
（108）北京肯特瑞财富管理有限公司
住所：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部
法定代表人：陈超
电话：4000988511，4000888816
传真：（010）89188000
联系人：赵德赛
客户服务电话：4000988511，4000888816
网址：http://fund.jd.com/
（109）北京新浪仓石基金销售有限公司
住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人：李昭琛
电话：（010）60619607
传真：8610-62676582
联系人：付文红
客户服务电话：（010）62675369
网址：www.xincai.com
（110）杭州科地瑞富基金销售有限公司
住所：杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址：杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼
法定代表人：陈刚
电话：（0571）85267500
传真：（0571）85269200
联系人：胡璇
客户服务电话：（0571）86655920
网址：www.cd121.com
（111）北京蛋卷基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区望京SOHO塔2B座2507
法定代表人：钟奎斐
电话：（010）61860688
传真：（010）61840699
联系人：戚晓强
客户服务电话：400-0618-518
网址：https://danjuanapp.com/
（112）凤凰金信（银川）投资管理有限公司
住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402(750000)
办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院朝来高科技产业园18号楼　(100000)
法定代表人：程刚
电话：（010）58160168
传真：（010）58160173
联系人：张旭
客户服务电话：400-810-5919
网址：www.fengfd.com
（113）深圳市金斧子基金销售有限公司
住所：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人：赖任军
电话：（0755）66892301
传真：（0755）66892399
联系人：张烨
客户服务电话：400-9500-888
网址：www.jfzinv.com
（114）上海朝阳永续基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区上丰路977号1幢B座812室
办公地址：上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼
法定代表人：廖冰
电话：（021）80234888
传真：（021）80234898
客户服务电话：400-699-1888
网址：www.998fund.com
（115）格上富信投资顾问有限公司
住所：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人：李悅章
电话：（010）85594745
传真：（010）65983333
联系人：张林
客户服务电话：400-066-8586
网址：www.igesafe.com
（116）苏州财路基金销售有限公司
住所：江苏省苏州市高新区华佗路99号6幢1008室
办公地址：江苏省苏州市姑苏区苏站路1599号7号楼1101室
法定代表人：高志华
电话：(0512)68603767
传真：(0512)68603767
联系人：马赛
客户服务电话：(0512)68603767
网址：www.caifo.com
（117）中民财富管理（上海）有限公司
住所：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层
法定代表人：弭洪军
电话：（021）33355392
传真：（021）63353736
联系人：茅旦青
客户服务电话：400-876-5716
网址：www.cmiwm.com
（118）上海万得基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区福山路33号9楼
法定代表人：王廷富
电话：021-50712782
传真：021-50710161
联系人：徐亚丹
客户服务电话：400-821-0203
网址：www.520fund.com.cn
（119）天津万家财富资产管理有限公司
住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人：李修辞
电话：（010）59013828
传真：（010）59013707
联系人：王芳芳
客户服务电话：010-59013842
网址：http://www.wanjiawealth.com/
（120）上海挖财金融信息服务有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：胡燕亮
电话：（021）50810687
传真：（021）58300279
联系人：李娟
客户服务电话：（021）50810673
网址：www.wacaijijin.com
（121）嘉实财富管理有限公司
住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人：赵学军
电话：（021）38789658
传真：（021）68880023
联系人：王宫
客户服务电话：400-021-8850
网址：www.harvestwm.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）登记结算机构
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)50938617
传真：(010)50938907
联系人：周刺

（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：上海源泰律师事务所
住所：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人：廖海
电话：（021）51150298
传真：（021）51150398
联系人：廖海
经办律师：梁丽金、刘佳

（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：朱宏宇
经办注册会计师：薛竟、朱宏宇

四、基金的名称
本基金名称：交银施罗德监筹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、基金的投资目标
本基金为一只监筹混合型基金，主要通过投资于业绩优良、发展稳定、在行业内占有支配性地位、分红稳定的监筹上市公司股票，在有效控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，追求在稳定分红的基础上实现基金资产的长期稳定增长。

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、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。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。
本基金的投资对象重点为业绩优良、发展稳定、在行业内占有支配性地位、分红稳定的监筹上市公司股票，满足上述条件的监筹股票占全部股票投资组合市值的比例不低于80%。
在正常市场情况下，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%（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，本基金具体配置比例由基金管理人根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化做主动调整，以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡，但比例不超出基金合同约定的限定范围。本基金的资产配置限制如下表所示。
表一：资产类别和配置比例

资产类别	资产配置范围
股票	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的其他证券品种	5-40%

八、基金的投资策略
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，通过优选业绩优良、发展稳定、在行业内占有支配性地位、分红稳定的监筹上市公司股票进行投资，以谋求基金资产的长期稳定增长。
1、资产配置
本基金采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统，结合定性分析和定量分析，形成对不同市场的预测和判断，确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整股票资产、债券资产和货币市场工具的比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。
2、行业配置
本基金将通过对经济周期、产业环境、产业政策和行业竞争格局的分析和预测，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，并据此对基金股票投资资产的行业分布进行动态调整。一般而言，对于国民经济增长中的领头行业，受国家政策重点扶持的优势行业，以及受国内外宏观经济运行有利因素影响行业景气良好的行业，为本基金重点投资的行业。
具体而言，我们通过以下几方面的分析对行业进行配置来优化投资组合：
① 宏观经济环境分析：通过对宏观经济数据如季度GDP增长率、每月CPI数据、M2增长速度、每月工业增加值增长速度等的跟踪研究，对宏观经济环境变动趋势进行预测分析，并对深入跟踪研究国家宏观政策和监管政策对市场和各个行业的影响，分析行业的发展环境，从而判断宏观经济周期对行业的影响；
② 行业景气度分析：以全球化的视角对各个行业的发展趋势进行分析，判断行业发展前景，通过商业模式和竞争力的分析寻找优势行业，通过对行业主营业务收入、产品价格、毛利率的变化等数据进行分析，寻找财务稳健和景气度反转的行业作为投资的重点；
③ 行业估值和动量分析：通过对市场及各个行业估值水平PE、PB等数据的横向、纵向分析，进行估值比较，并跟踪各个行业的资金流向、分析师盈利预测指数、机构持仓特征等，进行行业轮动配置。
3、股票选择
本基金综合运用施罗德集团的股票研究分析方法和其它投资分析工具，挑选具有分红稳定特征的监筹上市公司股票构建股票投资组合。具体分以下三个层次进行：
（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（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。
（2）监筹股优选
在海外股票市场上，投资人把那些在其所属行业内占有重要支配性地位、业绩优良、成交活跃、红利优厚的大公司股票称为监筹股。借鉴海外股票市场监筹股票的基本特性，结合中国股票市场的实际情况，本基金根据下述定性和定量的标准从通过品质筛选构建的备选股票池中挑选中国的监筹上市公司构建监筹核心股票池，并对核心股票池按照风格划分为不同的风格股票池：
1）监筹核心股票池
①具备相当的规模：总市值排名位于整个A股市场的前30%之列，或者总市值排名位于在所属行业内的前25%之列（按照GICS行业分类标准进行行业划分）；
②在其所属行业内占有重要支配性地位，具有较大市场占有率、市场影响力和较高的品牌价值，其中主营业务收入排名位列所属行业前50%；
③公司具有质量优良的成长性，通过对控制企业盈利增长质量的指标（如ROIC-WACC、EVA等）进行评估，挑选EVA不断增长或改善的优质公司；
④公司治理结构良好，管理规范、信息透明；
⑤主营业务鲜明，盈利能力强，收入和利润稳定增长；
⑥成交相对活跃；
⑦分红稳定且具有较高的现金股息收益率。
2）监筹风格股票池
我们对监筹核心股票池进行风格划分，指标监筹、成长监筹和红利监筹。指标监筹选取总市值最大的股票；成长监筹选取每股收益持续增长且增长率高的企业；红利监筹选取连续分红且股息率高的企业。
本基金管理人根据上述监筹股选择标准，在定量指标筛选和定性指标评价的基础上，自下而上优选具有稳定分红特征的监筹股，并根据市场轮动特征在监筹风格池中进行风格配置。满足上述条件的监筹上市公司股票占全部股票投资组合市值的比例不低于80%。
3）多元化价值评估
对上述核心股票池中的监筹上市公司进行内在价值的评估，在明确的价值评估基础上选择定价相对合理且成长性可持续的投资标的。
4、债券投资
在债券投资方面，本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本基金的债券投资采取主动的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。
在全球经济的框架下，本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化作出判断，运用数量化工具，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，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略和换券等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。
5、权证投资策略
本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。
6、资产支持证券投资策略
本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

九、基金的业绩比较标准
本基金的整体业绩比较基准采用：
75%×中证100指数+25%×中证综合债券指数
本基金股票投资部分的业绩比较基准是中证100指数，债券投资部分的业绩比较基准是中证综合债券指数。
本基金采用中证100指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要基于以下原因：
1.中证100指数从我国首个由官方推出的沪深两市统一指数——沪深300的样本股中挑选规模最大的100只股票组成样本股，以综合反映沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。
2.该指数科学地反应了我国资本市场上市公司市场变化水平，具有较高的权威性及市场代表性，投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取。
3.本基金的股票投资对象以监筹股为主，而这些股票通常都是中证100指数中重要的成分股，因此中证100指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。
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，则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意后调整本基金的业绩评价基准，并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征
本基金是一只混合型基金，以优质监筹股为主要投资对象，其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高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。
本基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定，于2018年1月19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2017年10月1日至2017年12月31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	1,995,422,921.72	79.43
	其中：股票	1,995,422,921.72	79.43
2	固定收益投资	124,212,300.00	4.94
	其中：债券	124,212,300.00	4.94
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	255,502,003.25	10.17
	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	129,534,510.41	5.16
7	其他资产	7,586,391.37	0.30
8	合计	2,512,258,126.75	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1.报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	35,849,044.00	1.44
B	采矿业	41,071,000.00	1.65
C	制造业	1,107,563,496.43	44.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	144,387,573.38	5.81
F	批发和零售业	193,326,948.00	7.77
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,030,748.67	1.89
J	金融业	290,892,208.00	11.70
K	房地产业	106,125,000.00	4.27
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	28,682,196.40	1.15
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	428,297.68	0.02
S	综合	-	-
	合计	1,995,422,921.72	80.23

2.2.报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。
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

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	002180	纳思达	7,300,000	199,363,000.00	8.02
2	300129	泰胜风能	16,813,190	135,346,179.50	5.44
3	300413	快乐购	4,207,638	125,597,994.30	5.05
4	601398	工商银行	20,000,000	124,000,000.00	4.99
5	600048	保利地产	7,500,000	106,125,000.00	4.27
6	601288	农业银行	27,000,000	103,410,000.00	4.16
7	002304	洋河股份	850,570	97,815,550.00	3.93
8	000858	五粮液	1,200,000	95,856,000.00	3.85
9	000538	云南白药	900,963	91,709,023.77	3.69
10	002001	新和成	2,100,000	79,926,000.00	3.21

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	119,886,000.00	4.82
	其中：政策性金融债	119,886,000.00	4.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	4,326,300.00	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	124,212,300.00	4.99

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	170203	17国开03	1,000,000	99,930,000.00	4.02
2	108601	国开1703	200,000	19,956,000.00	0.80
3	123004	铁汉转债	43,263	4,326,300.00	0.17

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	892,125.56
2	应收证券清算款	2,342,214.79
3	应收股利	-
4	应收利息	3,679,484.12
5	应收申购款	672,566.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,586,391.37

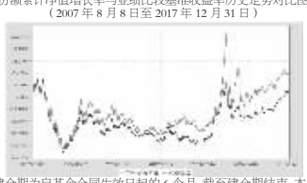
（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩
基金业绩截止日为2017年12月31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。
下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
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	0.75%	0.68%	6.06%	0.68%	-5.31%	0.00%
2017年度	17.57%	0.72%	22.11%	0.51%	-4.54%	0.21%
2016年度	-14.18%	1.72%	-4.83%	0.94%	-9.35%	0.78%
2015年度	47.46%	2.58%	1.76%	1.85%	45.70%	0.73%
2014年度	8.88%	0.99%	45.81%	1.01%	-36.93%	-0.02%
2013年度	5.40%	1.24%	-9.19%	1.10%	14.59%	0.14%
2012年度	10.24%	1.06%	9.41%	0.91%	0.83%	0.15%
2011年度	-22.85%	1.06%	-15.01%	0.95%	-7.84%	0.11%
2010年度	-9.78%	1.38%	-13.92%	1.19%	4.14%	0.19%
2009年度	71.61%	1.75%	61.89%	1.53%	9.72%	0.22%
2008年度	-50.01%	1.92%	-53.92%	2.26%	3.91%	-0.34%
2007年度(自基金合同生效日起至2007年12月31日)	9.61%	1.37%	11.80%	1.50%	-2.19%	-0.13%

注：本基金业绩比较基准自2015年10月1日起，由“75%×中证100指数+25%×中信全债指数”变更为“75%×中证100指数+25%×中证综合债券指数”，下图同。详情见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。
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

交银施罗德监筹混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2007年8月8日至2017年12月31日）



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、基托管人的托管费；
3、基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、基份额持有人大会费用；
6、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
7、基的证券交易费用；
8、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。
上述基费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。
本基金基金合同终止基金财产清算时所发生费用，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
在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下：
H = E×1.5%÷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，逐日累计至每月月末，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、公休假等，支付日期顺延。
（2）基金托管人的托管费
在通常情况下，基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H=E×0.25%÷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，逐日累计至每月月末，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3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。
（3）除管理费和托管费之外的基金费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，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
本基金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、登记结算等各项费用。
本基金的申购费率如下：

	申购金额(含申购费)	前端申购费率
申购费率(前端)	50万元以下	1.5%
	50万元(含)至100万元	1.2%
	100万元(含)至200万元	0.8%
	200万元(含)至500万元	0.5%
	500万元以上(含500万)	每笔交易1000元
	持有时间	后端申购费率
申购费率(后端)	1年以内(含)	1.8%
	1年—3年(含)	1.2%
	3年—5年(含)	0.6%
	5年以上	0

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。
本基金自2013年4月11日起，对通过本公司直销柜台申购本基金前端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，其中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前端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)	前端特定申购费率
特定申购费率(前端)	50万元以下	0.60%
	50万元(含)至100万元	0.48%
	100万元(含)至200万元	0.32%
	200万元(含)至500万元	0.20%
	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。
投资者通过直销机构交易享有如下费率优惠，有关费率优惠活动的具体费率折扣及活动起止时间如有变化，敬请投资者留意本基金管理人的有关公告，届时费率优惠相关事项以最新公告为准：
1）通过本基金管理人直销柜台办理本基金前端基金份额申购业务的投资者，享受前端申购费率一折优惠；对上述实施特定申购费率的养老金客户而言，以其目前适用的特定申购费率和上述一般申购费率的较低者执行。若享有折扣前的原申购费率为固定费用的，则按原固定费率执行，不再享有费率折扣。
2）通过本基金管理人网上直销交易平台办理本基金前端基金份额申购及定期定额投资业务的个人投资者享受前端申购费率及定期定额投资费率优惠，赎回费率标准不变。具体优惠费率请参见本基金管理人网站列示的网上直销交易平台申购费率表、定期定额投资费率表或相关公告。
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。
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。
（2）申购份额的计算
申购可以采取前端收费模式和后端收费模式。
前端收费模式：
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）
申购费用＝申购总金额－净申购金额
申购份额＝（申购总金额－申购费用）/ T日基金份额净值
例一：某投资人投资4万元申购本基金，申购费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.0400元，如果其选择前端收费方式，则其可得到的申购份额为：
申购总金额＝40,000元
净申购金额＝40,000/（1+1.5%）＝39,408.87元
申购费用＝40,000－39,408.87＝591.13元
申购份额＝（40,000－591.13）/1.0400＝37,893.14份
后端收费模式：
申购份额＝申购金额 /T日基金份额净值
当投资人提出赎回时，后端认购费用的计算方法为：
后端申购费用＝赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率
例二：某投资人投资4万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.0400元，如果其选择后端收费方式，则其可得到的申购份额为：
申购份额 ＝ 40,000 / 1.0400 ＝ 38,461.54份
即：投资人投资4万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.0400元，则可得到38,461.54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。
（3）赎回费用
赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用的25%归基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。
本基金的赎回费率如下：

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

（4）赎回金额的计算
赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准计算的赎回价格，赎回金额单位为元，计算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。
如果投资人在认（申）购时选择交纳前端认（申）购费用，则赎回金额的计算方法如下：
赎回费用＝赎回份额×T日基金份额净值×赎回费率
赎回金额＝赎回份额×T日基金份额净值－赎回费用
例三：某投资人赎回1万份基金份额，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为：
赎回费用 ＝ 10,000×1.0160×0.5% ＝ 50.80元
赎回金额 ＝ 10,000×1.0160－50.80 ＝ 10,109.20元
即：投资人赎回本基金1万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为10,109.20元。
如果投资人在认（申）购时选择交纳后端认（申）购费用，则赎回金额的计算方法如下：
赎回总额＝赎回份额×T日基金份额净值
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
例四：某投资人赎回1万份基金份额，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.0160元，投资人对应的后端申购费是1.8%，申购时的基金净值为1.0100元，则其可得到的赎回金额为：
赎回总额＝10,000×1.0160＝10,160元
后端申购费用＝10,000×1.0100×1.8%＝181.80元
赎回费用＝10,160×0.5%＝50.80元
赎回金额＝10,160－181.80－50.80＝9,927.40元
即：投资人赎回本基金1万份基金份额，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.0160元，投资人对应的后端申购费是1.8%，申购时的基金净值为1.0100元，则其可得到的赎回金额为9,927.40元。
（5）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。
（6）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