# 交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金（更新）招募说明书摘要

（2018年第1号）

## 基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司
## 基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

二〇一年五月

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】**

交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2016年8月11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【2016】1814号文准予募集注册。本基金基金合同于2016年11月28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：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；投资中小企业私募债的特有风险；投资资产支持证券的特有风险；投资本基金特有的其他风险等等。

本基金投资中小企业私募债，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

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2018年5月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年3月31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：郭佳敏
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。

陈朝灯先生，副董事长，博士学位。现任施罗德证券投资信托股份有限公司投资总监兼专户管理部主管。历任复华证券投资信托股份有限公司专户投资经理，景顺证券投资信托股份有限公司部门主管、投资总监。

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。

徐瀚先生，董事，硕士学位。现任交通银行个人金融业务部总经理。历任交通银行香港分行电脑中心副总经理，交通银行信息技术部副总经理，交通银行太平洋信用卡中心副首席执行官、首席执行官。

孙荣俊先生，董事，硕士学位，现任交通银行总行风险管理部（资产保全部）副总经理。历任交通银行总行风险管理部副高级经理、高级经理，交通银行广西区柳州分行副行长、交通银行内蒙古区分行行长助理。

李定邦先生，董事，硕士学位，现任施罗德集团亚太区行政总裁。历任施罗德投资管理有限公司亚洲投资产品总监，施罗德投资管理（香港）有限公司行政总裁兼亚太区基金业务拓展总监。

谢丹阳先生，独立董事，博士学位。现任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，武汉大学经济与管理学院院长、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。

张玲菡女士，监事、学士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司市场总监。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、营销管理部总经理。

余川女士，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总监。历任华泰证券股份有限公司综合发展部经理、投资银行部项目经理，银河基金管理有限公司监察部总监，交银施罗德基金管理有限公司监察稽核部总经理、监察风控副总监。

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，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。

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；交通银行资产托管业务中心副总裁；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。

印皓女士，副总经理，上海财经大学工商管理硕士。历任交通银行研究开发部副主管体改规划员，交通银行市场营销部副主管市场规划员、主管市场规划员，交通银行公司业务部副高级经理、高级经理，交通银行机构业务部高级经理、总经理助理、副总经理。

4、本基金基金经理

黄莹洁女士，香港大学工商管理硕士、北京大学经济学、管理学双学士。10年证券投资行业从业经验。2008年2月至2012年5月任中海基金管理有限公司交易员。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司，曾任中央交易室交易员。自2015年7月25日至2018年3月19日担任交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金基金经理。自2015年5月27日起担任交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理至今，自2015年5月27日起担任交银施罗德理财21天债券型证券投资基金基金经理至今，自2015年5月27日起担任交银施罗德现金宝货币市场基金基金经理至今，自2015年7月25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，自2015年12月29日起担任交银施罗德裕通纯债债券型证券投资基金基金经理至今，自2016年7月27日起担任交银施罗德活期通货币市场基金基金经理至今，自2016年10月19日起担任交银施罗德天利宝货币市场基金基金经理至今，自2016年11月28日起担任交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金基金经理至今，自2016年12月7日起担任交银施罗德天鑫宝货币市场基金基金经理至今，自2016年12月20日起担任交银施罗德天益宝货币市场基金基金经理至今，自2017年3月3日起担任交银施罗德境尚收益债券型证券投资基金基金经理至今。

连端清先生，复旦大学经济学博士。9年证券投资相关从业经验。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，2016年7月27日起担任交银施罗德活期通货币市场基金基金经理至今，2016年10月19日起担任交银施罗德天利宝货币市场基金基金经理至今，2016年11月28日起担任交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金基金经理至今，2016年12月7日起担任交银施罗德天鑫宝货币市场基金基金经理至今，2016年12月20日起担任交银施罗德天益宝货币市场基金基金经理至今，2017年3月3日起担任交银施罗德境尚收益债券型证券投资基金基金经理至今，2017年3月31日起担任交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金、交银施罗德裕盈纯债债券型证券投资基金、交银施罗德裕利纯债债券型证券投资基金基金经理至今，2017年12月29日起担任交银施罗德天运宝货币市场基金基金经理至今。

5、投资决策委员会成员

委员：阮红（总经理）
王少成（权益投资总监、基金经理）
齐晧（跨境投资总监、投资经理）
于海颖（固定收益（公募）投资总监、基金经理）
马俊（研究总监）

上述人员之间不存在近亲属关系。上述各项人员信息更新截止日为2018年5月28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：中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称：中国邮政储蓄银行)
住所：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城区金融大街 3 号A 座
法定代表人：李国华
成立时间：2007年3月6日
组织形式：股份有限公司
注册资本：810.31亿元人民币
存续期间：持续经营
批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复[2006]484号
基金托管资格批文及文号：证监许可【2009】673 号
托管部门联系人：王瑛
联系电话：（010）68858126

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；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；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

2、主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工23人，全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格，80%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。

3、托管业务经营情况

2009年7月23日，中国邮政储蓄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联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第16家托管银行。2012年7月19日，中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准，获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至2018年3月31日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共81只。至今，中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达43349.90亿元。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人，中国邮政储蓄银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国邮政储蓄银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置内部风险控制处室，配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核的工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人员负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（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

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，对违法违规行为及时予以风险提示，要求其限期纠正，同时报告中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

(1)每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2)收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3)通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，要求限期纠正，并及时报告中国证监会。

**三、相关服务机构**

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人以及基金管理人的网上直销交易平台（网站及APP，下同）。

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

个人投资者可以通过基金管理人网上直销交易平台办理开户、本基金的申购、赎回等业务，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。

2、除基金管理人之外的其他销售机构

（1）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

（2）珠海盈米财富管理有限公司
住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人：肖雯
电话：（020）89629099
传真：（020）89629011
联系人：黄敏嫦
客户服务电话：（020）89629066
网址：www.yingmi.cn

（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）50938617
传真：（010）50938907
联系人：周莉

（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：丁媛
经办律师：黎明、丁媛

（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
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：朱宏宇
经办注册会计师：薛竞、朱宏宇

**四、基金的名称**

本基金名称：交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金

**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**

本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争持续稳定地实现超越业绩比较基准的投资回报。

**七、基金的投资范围**

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国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、货币市场工具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（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

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：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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**

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，对宏观经济运行趋势、财政以及货币政策变化趋势作出分析和判断，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析和严格的风险控制基础上，综合考虑经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响，深入挖掘价值被低估的标的券种。

1、大类资产配置

本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过“自上而下”的定性

分析和定量分析相结合，形成对大类资产的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定债券类资产和现金类资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，以规避市场风险，提高基金收益率。

2、债券投资策略

（1）久期管理策略

作为债券基金最基本的投资策略，久期管理策略本质上是一种自上而下管理利率风险的策略。在全球经济的框架下，本基金管理人根据对市场利率变化趋势的预期，密切跟踪CPI、PPI、汇率、M2等利率敏感指标和宏观经济运行关键指标，运用数量化工具对宏观经济运行及货币财政政策变化跟踪与分析，对未来市场利率趋势进行分析预测，据此确定合理的债券组合目标久期。基金管理人通过以下方面的分析来确定债券组合的目标久期：

1）宏观经济环境分析。通过跟踪分析货币信贷、采购经理人指数等宏观经济先行性经济指标，拉动经济增长的三大引擎进出口、消费以及投资等指标，判断当前经济运行在经济周期中所处的阶段，预期中央政府的货币与财政政策取向。

2）利率变动趋势分析。在宏观经济环境分析的基础上，密切关注月度CPI、PPI等物价指数，货币信贷、汇率等金融运行数据，预测未来利率的变动趋势。

3）目标久期分析。根据宏观经济环境分析与市场利率变动趋势分析，结合当期债券收益率估值水平，确定投资组合的目标久期。原则上，在利率上行通道中，通过缩短目标久期规避利率风险；在利率下行通道中，通过延长目标久期分享债券价格上涨的收益。在利率持平阶段，采用骑乘策略与持有策略，获得稳定的当前回报。

4）动态调整目标久期。通过对国内外宏观经济数据、金融市场运行、货币政策以及国内债券市场运行跟踪分析，评估未来利率水平变化趋势，结合债券市场收益率变动与基金投资目标，动态调整组合目标久期。

（2）期限结构配置策略

通过预期收益率曲线形态变化来调整投资组合的期限结构配置策略。根据债券收益率曲线形态、各期限段品种收益率变动、结合短期资金利率水平与变动趋势，分析预测收益率曲线的变化，测算子弹、哑铃或梯形等不同期限结构配置策略的风险收益，形成具体的期限结构配置策略。

（3）债券的类别配置策略

对不同类别债券的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，综合评估相同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，通过不同类别资产的风险调整后收益比较，确定组合的类别资产配置。

（4）骑乘策略

骑乘策略，通过对债券收益曲线形状变动的预期为依据来建立和调整组合。当债券收益率曲线比较陡峭时，买入位于收益率曲线陡峭处的债券，持有一段时间后，伴随债券剩余期限的缩短与收益率水平的下降，获得一定的资本利得收益。

（5）杠杆放大策略

当回购利率低于债券收益率时，本基金将实施正回购融入资金并投资于信用债券等可投资标的，从而获取收益率超出回购资金成本（即回购利率）的套利价值。

（6）信用债券投资策略

本基金信用债券的投资遵循以下流程：

1）信用债券研究

信用分析师通过系统的案头研究、走访发行主体、咨询发行中介等各种形式，“自上而下”地分析宏观经济运行趋势，行业（或产业）经济前景，“自下而上”地分析发行主体的发展前景、偿债能力、国家信用支撑等。通过交银施罗德的信用债券信用评级指标体系，对信用债券进行信用评级，并在信用评级的基础上，建立本基金的信用债券池。

2）信用债券投资

基金经理从信用债券池中精选债券构建信用债券投资组合。

本基金构建和管理信用债券投资组合时主要考虑以下因素：

①信用债券信用评级的变化。

②不同信用等级的信用债券，以及同一信用等级不同标的债券之间的信用利差变化。

原则上，购买信用（拟）增级的信用债券，减持信用（拟）降级的信用债券；购买信用利差扩大后存在收窄趋势的信用债券，减持信用利差缩小后存在放宽趋势的信用债券。

（7）中小企业私募债券投资策略

本基金投资中小企业私募债将重点关注其信用风险和流动性风险，综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，在信用风险可控的前提下，追求合理回报。本基金采取自下而上的方法建立适合中小企业私募债的信用评级体系，对个券进行信用分析，根据内部的信用分析方法对可选的中小企业私募债券个券进行严格筛选过滤：重点分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素，对主体所发行债券进行打分和投资价值评估，分数高于内部投资级要求才能入库投资。中小企业私募债券投资是综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性，选择发行主体资质优良，估值合理且流通相对充分的品种进行适度投资。

3、资产支持证券投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。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、基金的业绩比较基准**

中债综合全价指数收益率

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。

本基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年4月20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2018年1月1日至2018年3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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 746,421,300.00 | 98.20 |
| | 其中：债券 | 746,421,300.00 | 98.20 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 440,638.37 | 0.06 |
| 8 | 其他各项资产 | 13,231,480.27 | 1.74 |
| 9 | 合计 | 760,093,418.64 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

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

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 | 30,027,000.00 | 5.43 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,027,000.00 | 5.43 |
| 4 | 企业债券 | 19,758,000.00 | 3.58 |
| 5 | 企业短期融资券 | 130,719,000.00 | 23.66 |
| 6 | 中期票据 | 527,805,300.00 | 95.53 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 38,112,000.00 | 6.90 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 746,421,300.00 | 135.10 |

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 | 041760057 | 17西安高新CP002 | 500,000 | 50,240,000.00 | 9.09 |
| 2 | 101760007 | 17象屿 MTN001 | 400,000 | 39,752,000.00 | 7.20 |
| 3 | 101658015 | 16雨花国投MTN001 | 400,000 | 39,308,000.00 | 7.11 |
| 4 | 101652045 | 16许继 MTN001 | 400,000 | 38,948,000.00 | 7.05 |
| 5 | 101456057 | 14榕交建MTN001 | 300,000 | 30,570,000.00 | 5.53 |

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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 13,231,480.27 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 13,231,480.27 |

（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

本基金本报告期末未持有股票。

（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2018年3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。

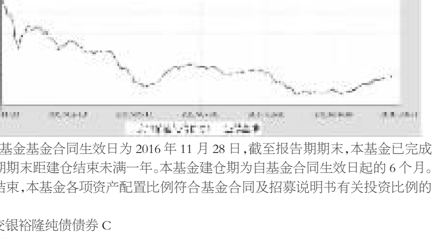
1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| A类 | 过去三个月 | 1.93% | 0.04% | 1.14% | 0.04% | 0.79% | 0.00% |
| | 2017年度 | 3.07% | 0.05% | -3.38% | 0.06% | 6.45% | -0.01% |
| | 2016年度（自基金合同生效日起至2016年12月31日） | 0.28% | 0.03% | -1.73% | 0.21% | 2.01% | -0.18% |
| C类 | 过去三个月 | 1.84% | 0.03% | 1.14% | 0.04% | 0.70% | -0.01% |
| | 2017年度 | 2.48% | 0.04% | -3.38% | 0.06% | 5.86% | -0.02% |
| | 2016年度（自基金合同生效日起至2016年12月31日） | 0.25% | 0.03% | -1.73% | 0.21% | 1.98% | -0.18% |

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

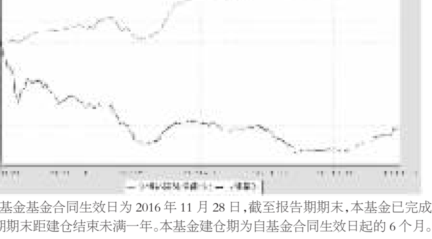
交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2016年11月28日至2018年3月31日）

（1）交银裕隆纯债债券A



注：本基金基金合同生效日为2016年11月28日，截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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）交银裕隆纯债债券C



注：本基金基金合同生效日为2016年11月28日，截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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、仲裁费和诉讼费；
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0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.3%÷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。由基金管理人向基金托管人发送划款指令，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，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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷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。由基金管理人向基金托管人发送划款指令，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取，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×0.4%÷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

C类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送划款指令，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。

（4）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或摊入当期费用，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）申购费用

本基金基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。投资人申购A类基金份额在申购时支付申购费用、赎回时收取赎回费用，申购C类基金份额不支付申购费用、赎回时收取赎回费用，并从该类别基金资产中计提销售服务费。

A类基金份额的申购费用由A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，申购费用按每笔申购申请单独计算。

本基金A类基金份额（非养老金客户）的申购费率如下：

| | 申购金额（含申购费） | A类基金份额申购费率 |
|---|---|---|
| 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% |
| | 500万元以上（含500万） | 每笔交易500元 |

持有A类基金份额的投资人因红利自动再投资而产生的A类基金份额，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：

1）全国社会保障基金；
2）可以投资基金的地方社会保障基金；
3）企业年金单一计划以及集合计划；
4）企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；
5）企业年金养老金产品。

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，基金管理人可在招募说明书更新或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） | A类基金份额特定申购费率 |
|---|---|---|
| 申购费率 | 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500元 |

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A类基金份额申购业务的投资者，享受申购费率一折优惠；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一折优惠中孰低者执行。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A类基金份额申购业务的个人投资者享受申购费率优惠，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

1）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）

[illegible]

例一：某投资者（非养老金客户）投资100,000元申购本基金的A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.0400元，申购费率为0.8%，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）/1.0400＝95,390.72份

即：某投资者（非养老金客户）投资100,000元申购本基金，假设申购当日A类基金份额净值为1.0400元，如果其选择申购A类基金份额，则其可得到95,390.72份A类基金份额。

例二：某养老金客户投资100,000元通过基金管理人的直销柜台申购本基金的A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.0400元，申购费率为0.32%，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+0.32%）＝99,681.02元
申购费用＝100,000-99,681.02＝318.98元
申购份额＝（100,000-318.98）/1.0400＝95,847.13份

即：该养老金客户投资100,000元通过基金管理人的直销柜台申购本基金的A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.0400元，则其可得到95,847.13份A类基金份额。

2）C类基金份额的申购

如果投资者选择申购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：某投资者投资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1.0400元，则其可得到的申购份额为：

申购份额＝100,000/1.0400＝96,153.85份

即：投资者投资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1.0400元，则其可得到96,153.85份C类基金份额。

（3）赎回费用

投资者赎回A类基金份额或C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。本基金A类基金份额和C类基金份额的赎回费用由该类基金份额赎回人承担，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。其中，对持续持有期少于7日的基金份额持有人收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

本基金A类基金份额的赎回费率如下：

| | 持有期限 | 赎回费率 |
|---|---|---|
| A类基金份额的赎回费率 | 7天以内 | 1.5% |
| | 7天（含）—1年（含） | 0.1% |
| | 1年—2年（含） | 0.05% |
| | 2年以上 | 0 |

上表中的“年”指的是365个自然日。

本基金C类基金份额的赎回费率如下：

| | 持有期限 | 赎回费率 |
|---|---|---|
| C类基金份额的赎回费率 | 7天以内 | 1.5% |
| | 7天（含）—30天 | 0.5% |
| | 30天（含）以上 | 0 |

自2017年1月10日起，本基金对通过基金管理人直销柜台赎回A类基金份额的投资者，实施赎回费率优惠，详情请见《交银施罗德基金管理有限公司关于在指定渠道开展交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金A类基金份额赎回费率优惠的公告》或其他相关公告。

（4）赎回金额的计算

A类基金份额或C类基金份额的赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用，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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

1）A类基金份额的赎回

如果投资者赎回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类基金份额净值×赎回费率
赎回金额＝赎回份额×T日A类基金份额净值－赎回费用

例一：某投资者在持有期限超过7日、少于一年时赎回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类基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用＝100,000×1.0160×0.1%＝101.60元
赎回金额＝100,000×1.0160-101.60＝101,498.40元

即：投资者在持有期限超过7日、少于一年时赎回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类基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为101,498.40元。

2）C类基金份额的赎回

投资者赎回C类基金份额，赎回金额的计算方法如下：

赎回费用＝赎回份额×T日C类基金份额净值×赎回费率
赎回金额＝赎回份额×T日C类基金份额净值－赎回费用

例二：某投资者在持有期限超过7日、少于30日时赎回100,000份C类基金份额，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日C类基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用＝100,000×1.0160×0.5%＝508.00元
赎回金额＝100,000×1.0160-508.00＝101,092.00元

即：投资者在持有期限超过7日、少于30日时赎回100,000份C类基金份额，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日C类基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为101,092.00元。

（5）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。

（6）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，在履行适当程序后调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。降低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“一、绪言”中相关内容。
（三）更新了“二、释义”中相关内容。
（四）更新了“三、基金管理人”中相关内容。
（五）更新了“四、基金托管人”中相关内容。
（六）更新了“五、相关服务机构”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”中相关内容，数据截止到2018年3月31日。
（九）更新了“十、基金的业绩”中相关内容，数据截止到2018年3月31日。
（十）更新了“十二、基金资产的估值”中相关内容。
（十一）更新了“十六、基金的信息披露”中相关内容。
（十二）更新了“十七、风险揭示”中相关内容。
（十三）更新了“二十、托管协议的内容摘要”中相关内容。
（十四）更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”中相关内容。
（十五）更新了“二十二、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
二〇一八年七月十二日

---

## 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）的公告

公告送出日期：2018年7月12日

1 公告基本信息

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 交银持续成长主题混合 | |
| 基金主代码 | 005001 | |
| 基金管理人名称 | 交银施罗德基金管理有限公司 | |
| 公告依据 | 《交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金基金合同》、《交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金招募说明书》等 | |
| 暂停相关业务的起始日、金额及原因说明 | 暂停大额申购起始日 | 2018年7月12日 |
| | 暂停大额转换转入起始日 | 2018年7月12日 |
| | 暂停大额定期定额投资起始日 | 2018年7月12日 |
| | 限制大额申购金额（单位：元） | 1,000,000 |
| | 限制大额转换转入金额（单位：元） | 1,000,000 |
| | 限制大额定期定额投资金额（单位：元） | 1,000,000 |
| | 暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）的原因说明 | 为保护现有基金份额持有人的利益，稳定基金规模，追求平稳运作 |

注：除了对单笔金额在人民币100万元以上(不含100万元)的申购及转换入申请（含定期定额投资业务发起的申购申请）进行限制外，对于当日单个基金账户累计申购及转换入金额在人民币100万元以上（不含100万元）的申购及转换入申请（含定期定额投资业务发起的申购申请），本基金管理人也有权拒绝，不予确认。

2 其他需要提示的事项

（1）在本基金上述暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）业务期间，本基金的赎回、转换转出业务正常进行。

（2）关于取消上述暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）业务限制的时间，本基金管理人将另行公告。

（3）投资者可以登录本公司网站（www.fund001.com）或拨打客户服务电话（400-700-5000，021-61055000）咨询基金相关信息。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责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，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。

特此公告。

---

## 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）的公告

公告送出日期：2018年7月12日

1 公告基本信息

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 交银优势行业混合 | |
| 基金主代码 | 519697 | |
| 基金管理人名称 | 交银施罗德基金管理有限公司 | |
| 公告依据 | 《交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》等 | |
| 暂停相关业务的起始日、金额及原因说明 | 暂停大额申购起始日 | 2018年7月12日 |
| | 暂停大额转换转入起始日 | 2018年7月12日 |
| | 暂停大额定期定额投资起始日 | 2018年7月12日 |
| | 限制大额申购金额（单位：元） | 1,000,000 |
| | 限制大额转换转入金额（单位：元） | 1,000,000 |
| | 限制大额定期定额投资金额（单位：元） | 1,000,000 |
| | 暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）的原因说明 | 为保护现有基金份额持有人的利益，稳定基金规模，追求平稳运作 |

注：除了对单笔金额在人民币100万元以上(不含100万元)的申购及转换入申请（含定期定额投资业务发起的申购申请）进行限制外，对于当日单个基金账户累计申购及转换入金额在人民币100万元以上（不含100万元）的申购及转换入申请（含定期定额投资业务发起的申购申请），本基金管理人也有权拒绝，不予确认。

2 其他需要提示的事项

（1）在本基金上述暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）业务期间，本基金的赎回、转换转出业务正常进行。

（2）关于取消上述暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）业务限制的时间，本基金管理人将另行公告。

（3）投资者可以登录本公司网站（www.fund001.com）或拨打客户服务电话（400-700-5000，021-61055000）咨询基金相关信息。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责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，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。

特此公告。