

## 交银施罗德基金管理有限公司 关于交银施罗德荣祥保本混合型 证券投资基金第十一次分红的公告

公告送出日期:2015年4月23日

1.公告基本信息	
基金名称	交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金
基金简称	交银荣祥保本混合
基金主代码	519076
基金合同生效日	2013年4月24日
基金管理人名称	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司
收益分配基准日	2015年4月15日
截止收益分配基准日的基金份额持有人的基金份额总额(单位:元)	1,068
截止收益分配基准日的可供分配利润(单位:元)	13,291,769.53
截止收益分配基准日的可供分配利润占基金份额持有人的基金份额比例	1,275,064.72
本次分红方案(单位:元/10份基金份额)	0.360
首次分红日期	2015年4月23日

注:根据本基金基金合同约定:保本周期内,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的60%。在符合上述约定收益分配次数和比例的前提下,当本基金自最近一次分红除息日以来(若尚未分红,则自基金合同生效日以来)的份额累计净值增长率达到或超过15%,或者每基金份额可供分配利润达到或超过0.03元时,本基金管理人应在接下来的15个工作日内进行收益分配。截止2015年4月15日,本基金可供分配利润为13,291,769.53元,每基金份额可供分配利润为0.0448元。“截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额”=基准日基金可供分配利润×60%,因此按照基金合同约定的分红比例计算,本次需分配的最低金额为7,975,061.72元。

2.与分红相关的其他信息

基金名称	2015年4月23日
除息日	2015年4月27日
红利发放日	2015年4月29日
分红对象	权益登记日登记在册的本基金份额持有人
分红费率	本基金在保本周期内收益分配采取一种收益分配方式,不进行红利再投资。
涉及赎回费等相关事项的说明	本基金在保本周期内收益分配采取一种收益分配方式,不进行红利再投资。
税收相关事项的说明	根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,基金投资者从基金分配中获得的基金分红,暂免征收所得税。
费用相关事项的说明	本基金本周期收益分配手续费率为0。

注:1.本次分红为基金合同生效以来的第十一次分红。  
2.本分红方案经本基金管理人计算并由基金托管人中国农业银行股份有限公司复核。  
3.基金份额持有人的红利款将于2015年4月29日自基金托管账户划出。  
4.其他需要提示的事项  
1.本基金将于2015年4月27日完成权益登记。  
2.本基金直销机构为公司的直销中心以及公司的网上直销交易平台。其他销售机构的地址及联系方式等有关信息,请详见本基金最新招募说明书“五、相关服务机构”章节及相关公告,或拨打本公司客户服务电话进行咨询。  
3.权益登记日申请申购的基金份额不享有本次分红权益,权益登记日申请赎回的基金份额享有本次分红权益。  
4.本公司可以根据市场情况及本基金净值波动的客观因素,在不违反本基金基金合同的前提下,于权益登记日调整最终的分红方案并提前公告。  
5.投资者欲了解有关分红的详细情况,可到各销售网点或通过本公司客户服务中心查询(网址:www.fund001.com, www.bocomschroder.com; 客户服务电话:400-700-5000, 021-61055000)。  
风险提示:基金的分红行为将导致基金净值产生波动,但不会影响基金的风险收益特征。本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将来表现。投资有风险,敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件,并选择适合自己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 关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告

依据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2008]38号)的有关规定和《关于发布中伙协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》的指导意见,经与基金托管人协商一致,交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)旗下管理的交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理型开放式指数证券投资基金、交银施罗德阿尔法核心股票型证券投资基金、交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金等其所持有的华域汽车(证券代码:600741)股票自2015年4月22日起按照指数收益法进行估值。该股票的交易所每日股票市场交易特征后,将恢复为采用当日收盘价进行估值。如有环境变化,本基金管理人也可采用其他合理的估值方法进行估值。  
如有疑问,请拨打客户服务热线:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,或登陆本基金管理人网站www.fund001.com, www.bocomschroder.com获取相关信息。  
风险提示:本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将来表现。投资有风险,敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件,并选择适合自己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 关于以通讯方式召开交银施罗德 沪深300行业分层等权重指数证券投资基金 基金份额持有人大会的第一次提示性公告

交银施罗德基金管理有限公司已于2015年4月22日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及交银施罗德基金管理有限公司网站(www.fund001.com, www.bocomschroder.com)发布了“交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告”。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开,根据基金合同的相关规定,发布本次基金份额持有人大会的第一次提示性公告。  
一、召开会议基本情况  
根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作管理办法》”)和《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金(以下简称“交银荣祥”)、本基金,基金代码:前端19714;后端519715)的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)决定以通讯方式召集本基金的基金份额持有人大会,审议本基金转型方案及基金合同修改等相关事宜,将本基金转型为“交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金”,并对基金合同进行修订。会议的具体安排如下:  
1.会议召开方式:通讯方式  
2.会议投票表决起止时间:自2015年5月1日起至2015年5月25日17:00止(以基金管理人收到表决票的时间为准)  
3.会议纸质表决票的送达地点:  
收件人:交银施罗德基金管理有限公司  
地址:上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期22楼  
邮政编码:200120  
联系人:余川  
联系电话:021-61055060  
通过专人送达、邮寄送达的,请在信封背面注明系用于本基金基金份额持有人大会表决之用(如“交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”)。  
二、会议审议事项  
本次会议审议事项为《关于交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》(见附件一)。  
上述议案的内容说明见《关于交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》(见附件四)。  
三、权益登记日  
本次大会的权益登记日为2015年4月30日,即该日在本基金注册登记机构登记在册的交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金(包括前端收费模式和后端收费模式的基金份额)全体基金份额持有人或其授权的代理人均有权参加本次基金份额持有人大会。  
四、表决票的填写和寄交方式  
本次持有人大会的表决方式仅限于书面纸质表决。  
1.本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站(www.fund001.com, www.bocomschroder.com)下载并打印等方式填制表决票。  
2.基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容,其中:  
(1)个人投资者自行投票的,需在表决票上签字,并提供本人身份证件正反两面复印件;  
(2)机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业

务公章(以下合称“公章”),并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书,有权利部门的批文或登记证书复印件等)。如受托人为个人,需提供提供受托人的身份证件复印件;如受托人为机构,还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书,有权利部门的批文或登记证书复印件等)。  
五、授权  
为了方便基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会,使基金份额持有人对本次大会充分表达其意见,基金份额持有人除可以直接投票外,还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,基金份额持有人授权他人基金份额持有人大会上表决需符合以下规则:  
(一)委托人  
本基金的基金份额持有人可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。  
基金份额持有人可在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以注册登记机构的登记为准。  
(二)受托人  
基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律法规的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。  
(三)授权方式  
本基金的基金份额持有人仅可通过纸面的授权方式授权受托人代为行使表决权,授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站(www.fund001.com, www.bocomschroder.com)下载并打印等方式获取授权委托样本。  
1.基金份额持有人进行纸质投票所需提供的文件:  
(1)个人基金份额持有人委托他人投票的,受托人应提供由委托人填写并签署授权委托书的原件,授权委托书的格式可参考附件三(样本),并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件;如受托人为个人,还需提供受托人的身份证明文件复印件;如受托人为机构,还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书,有权利部门的批文或登记证书复印件等)。  
(2)机构投资者委托他人投票的,受托人应提供由委托人填写的授权委托书的原件(授权委托书的格式可参考附件三(样本))并加盖公章(如有),有权利部门的批文或登记证书复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书,有权利部门的批文或登记证书复印件等))。  
(3)如受托人既进行委托授权,自身又送达了有效表决票,则以自身有效表决票为准。  
六、会议召开的条件和表决票数要求  
本次会议召开的条件为:本基金直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%)。  
本次会议表决的票数要求为:基金份额持有人持有的每一基金份额拥有同等的投票权。本次会议按一般决议处理,《关于交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效,基金管理人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。  
七、计票  
1.本次通讯会议的计票方式为:由本基金管理人授权的两名监事人在基金托管人(中国建设银行股份有限公司)授权代表的监督下在表决截止日后的次日的工作日进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。  
2.表决票效力的认定如下:  
(1)纸质表决票通过专人送达或邮寄送达本公告规定的收件人的,表决时间以收到时间为准。2015年5月25日17:00以后送达基金管理人,为无效表决。  
(2)纸质表决票的效力认定:  
①纸质表决票填写完整清晰,所提供文件符合本次会议通知规定,且在截止时间之前送达基金管理人的,为有效表决票;有效表决票按表决意见计入相应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。  
②如表决票上的表决意见未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断,但其他各项符合会议通知规定的,视为弃权表决,计入有效表决票并按“弃权”计入对应的表决结果,其所代表的基金份额不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。  
③如表决票上签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在规定时间内之前送达基金管理人的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。  
④各表决票表决意见相同,则视为同一表决票;如各表决票表决意见不相同,则按如下原则处理:  
A.送达时间不是同一天的,以最后送达的填写有效表决票为准,先送达的表决票视为被撤回;  
B.送达时间为同一天的,视为在同一表决票上做出了不同表决意见,计为弃权表决;  
C.送达时间按如下原则确定:专人送达的以实际递交时间为准,邮寄的以基金管理人收到的时间为准。  
八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权  
根据《基金法》及《基金合同》的规定,本次持有人大会需要参加大会的基金份额持有人或其代理人所持的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%)方可举行。如果本次基金份额持有人大会未达到上述要求而不能成功召开,根据2013年6月1日生效的《基金法》,本基金管理人可在规定时间内(即本次会议公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后,六个月内)就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会,应当当代表1/3以上(含1/3)基金份额持有人或其授权的代理人参加,方可召开。重新召集基金份额持有人大会时,除非授权文件另有载明,本次基金份额持有人大会召开期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效,但如授权方式发生说明变化或者基金份额持有人重新作出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细规则见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知(如有)。  
九、表决权行使  
1.召集人:交银施罗德基金管理有限公司  
联系地址:上海浦东新区世纪大道号国金中心二期21-22楼  
联系人:余川  
联系电话:(021)61055050  
客户服务电话:400-700-5000(免长途话费),(021)61055000  
网址:www.fund001.com, www.bocomschroder.com  
2.基金托管人:监督人:中国建设银行股份有限公司  
联系地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼  
客户服务电话:95533  
网址:www.ccb.com  
3.公证机关:上海市东方公证处  
联系地址:上海市凤阳路660号  
联系人:林奇  
联系电话:(021)62154848  
邮政编码:200041  
4.见证律师事务所:上海通力律师事务所  
联系电话:(021)31358666

十、重要提示  
1.请基金份额持有人在提交表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决票。  
2.本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查询,投资者如有任何疑问,可致电本基金管理人客户服务电话400-700-5000(免长途话费),(021)61055000咨询。  
3.基金管理人将在发布本公告后2个工作日内连续公布相关提示性公告,就持有人大会相关情况做必要说明,请予以留意。  
4.本次基金份额持有人大会召开期间,投资人可以按照本基金招募说明书的相关规定正常办理申购、赎回、转换及定期定额投资业务,业务受理不受影响。相关业务受理若有变化,详见基金管理人发布的相关公告。  
5.如本次基金份额持有人大会不能成功召开或者未能通过本次大会审议的议案,根据《基金法》和《基金合同》的有关规定,本基金可能会重新召开基金份额持有人大会。  
6.本公告的有关内容由交银施罗德基金管理有限公司负责解释。  
交银施罗德基金管理有限公司  
二〇一五年四月二十三日

## 交银施罗德基金管理有限公司 二〇一五年四月二十三日

附件一:《关于交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》  
附件二:《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金份额持有人大会表决票》  
附件三:《授权委托书》  
附件四:《关于交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》

关于交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称:	同意	反对	弃权
证件号码(身份证号码/营业执照号):			
事项说明			
关于《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》			
基金份额持有人/受托人签名或盖章: @@@@			
日期:			
说明:			
1.本表决票中“证件号码”,仅指基金份额持有人持有本基金基金份额的基金账号当前所使用的证件号码,基金份额持有人若因证件号码发生变更或其他原因不确定其基金账号当前所使用的证件号码,可拨打本基金管理人客户服务电话400-700-5000(免长途话费),(021)61055000查询。			
2.请填明“同意”、“反对”或“弃权”,并在相应栏内划“√”,同一议案只能选择一项意见。			
3.基金份额持有人开立持有本基金的基金账户为多个的,若无法注明,以上表述应视为持有人承认其委托他人拥有全部基金份额所持有的本基金全部份额的授权作出上述表决。			
4.表决票未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票视为无效的表决票,不作为基金份额持有人大会表决票,请基金份额持有人重新作出授权,并以最新方式或最新授权为准,详细规则见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知(如有)。			

注:1.本表决票中“证件号码”,仅指基金份额持有人持有本基金基金份额的基金账号当前所使用的证件号码,基金份额持有人若因证件号码发生变更或其他原因不确定其基金账号当前所使用的证件号码,可拨打本基金管理人客户服务电话400-700-5000(免长途话费),(021)61055000查询。  
2.请填明“同意”、“反对”或“弃权”,并在相应栏内划“√”,同一议案只能选择一项意见。  
3.基金份额持有人开立持有本基金的基金账户为多个的,若无法注明,以上表述应视为持有人承认其委托他人拥有全部基金份额所持有的本基金全部份额的授权作出上述表决。  
4.表决票未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票视为无效的表决票,不作为基金份额持有人大会表决票,请基金份额持有人重新作出授权,并以最新方式或最新授权为准,详细规则见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知(如有)。  
5.如本次基金份额持有人大会不能成功召开或者未能通过本次大会审议的议案,根据《基金法》和《基金合同》的有关规定,本基金可能会重新召开基金份额持有人大会。  
6.本公告的有关内容由交银施罗德基金管理有限公司负责解释。  
交银施罗德基金管理有限公司  
二〇一五年四月二十三日

附件二: 交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称:	同意	反对	弃权
证件号码(身份证号码/营业执照号):			
事项说明			
关于《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》			
基金份额持有人/受托人签名或盖章: @@@@			
日期:			
说明:			
1.本表决票中“证件号码”,仅指基金份额持有人持有本基金基金份额的基金账号当前所使用的证件号码,基金份额持有人若因证件号码发生变更或其他原因不确定其基金账号当前所使用的证件号码,可拨打本基金管理人客户服务电话400-700-5000(免长途话费),(021)61055000查询。			
2.请填明“同意”、“反对”或“弃权”,并在相应栏内划“√”,同一议案只能选择一项意见。			
3.基金份额持有人开立持有本基金的基金账户为多个的,若无法注明,以上表述应视为持有人承认其委托他人拥有全部基金份额所持有的本基金全部份额的授权作出上述表决。			
4.表决票未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票视为无效的表决票,不作为基金份额持有人大会表决票,请基金份额持有人重新作出授权,并以最新方式或最新授权为准,详细规则见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知(如有)。			

注:1.本表决票中“证件号码”,仅指基金份额持有人持有本基金基金份额的基金账号当前所使用的证件号码,基金份额持有人若因证件号码发生变更或其他原因不确定其基金账号当前所使用的证件号码,可拨打本基金管理人客户服务电话400-700-5000(免长途话费),(021)61055000查询。  
2.请填明“同意”、“反对”或“弃权”,并在相应栏内划“√”,同一议案只能选择一项意见。  
3.基金份额持有人开立持有本基金的基金账户为多个的,若无法注明,以上表述应视为持有人承认其委托他人拥有全部基金份额所持有的本基金全部份额的授权作出上述表决。  
4.表决票未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票视为无效的表决票,不作为基金份额持有人大会表决票,请基金份额持有人重新作出授权,并以最新方式或最新授权为准,详细规则见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知(如有)。  
5.如本次基金份额持有人大会不能成功召开或者未能通过本次大会审议的议案,根据《基金法》和《基金合同》的有关规定,本基金可能会重新召开基金份额持有人大会。  
6.本公告的有关内容由交银施罗德基金管理有限公司负责解释。  
交银施罗德基金管理有限公司  
二〇一五年四月二十三日

附件三: 授权委托书

本人(或本机构)持有交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金份额,就交银施罗德基金管理有限公司官网(www.fund001.com, www.bocomschroder.com)及《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》于2015年4月22日公布的《交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》所述需基金份额持有人大会审议的事项,本人(或本机构)的意见为(请在意见栏下方划“√”):

本人(或本机构)特此授权 代表本人(或本机构)参加审议上述事项的基金份额持有人大会,并按照上述意见行使表决权。  
上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的持有人大会的,以最多两次重新召开持有人大会为限,本授权继续有效。  
委托人(签字/盖章):  
受托人证件号码(填写):  
受托人(签字/盖章):  
受托人证件号码(填写):  
签署日期: 年 月 日  
授权委托书填写注意事项:  
1.基金份额持有人可以委托符合法律和本公告规定的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。  
2.基金份额持有人开立持有本基金的基金账户为多个的,若仅其中部分账户所持有的本基金份额授权受托人全部账户和股票的,应当注明该账户号码。若不注明,视为授权受托人将其全部账户所持有的本基金份额参与进行投票。如受托人未在授权委托表示中明确其表决意见,视为委托授权受托人按照受托人的意志行使表决权;如受托人在授权委托表示中表达多种表决意见,视为无效授权。  
3.本授权委托书(样本)中“委托人证件号码”,仅指基金份额持有人持有本基金基金份额的基金账号当前所使用的证件号码,基金份额持有人若因证件号码发生变更或其他原因不确定其基金账号当前所使用的证件号码,可拨打本基金管理人客户服务电话400-700-5000(免长途话费),(021)61055000查询。  
4.具体的授权效力确定规则请参见《交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》正文。  
5.如本次持有人大会权益登记日,投资者未在本基金注册登记机构登记在册,则其授权无效。  
6.授权委托书可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站(www.fund001.com, www.bocomschroder.com)并打印等方式获取,在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四: 关于交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明

一、重要提示  
交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金(以下简称“交银施罗德300等权重基金”或“本基金”)于2012年11月7日成立并正式运作。鉴于目前市场环境变化,为更好地满足投资者需求,保护基金份额持有人的利益,提高产品的市场竞争力,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,提议召开本基金的基金份额持有人大会,审议本基金转型及基金合同修改事宜,将本基金转型为“交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金”,并对基金合同进行修订。  
本次交银施罗德300等权重指数基金转型方案及基金合同修改需经参加本次持有人大会的基金份额持有人及代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效,故本转型方案存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效,基金管理人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案,中国证监会对本次转型方案备案,不代表其对本次转型方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。  
二、基金转型方案要点  
(一)变更基金名称  
基金名称由“交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金”变更为“交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金”。  
(二)变更《基金合同》名称  
将《基金合同》的名称由“交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金合同”变更为“《交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金基金合同》”。  
(三)修改基金投资相关内容  
1.投资目标  
本基金的投资目标是:“紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。”  
转型后投资目标拟修改为:“本基金通过重点投资于与消费服务相关的优质企业,把握经济转型升级背景下中国消费升级蕴含的投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。”  
2.投资范围  
本基金的投资范围是:“本基金投资于具有良好流动性的金融工具,以沪深300行业分层等权重指数的成份股及其备选成份股中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市(下)股票为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、新股(首次发行或增发)、债券、货币市场工具、回购、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入基金投资范围。”  
3.基金的投资组合比例  
本基金的投资组合比例为:“本基金投资于沪深300行业分层等权重指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%,持有现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。”  
转型后投资组合拟修改为:“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(下)的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市(下)的股票)、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会批准的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)。”  
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入基金投资范围。  
4.基金的投资组合比例  
本基金的投资组合比例为:“本基金投资于消费服务类行业的公司股票不低于非现金基金资产的80%;其余资产投资于债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会批准的允许本基金投资的其他证券品种;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易所保证金后,本基金持有的现金或者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%。”  
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。”  
3.投资策略  
鉴于投资目标、投资范围进行了修改,投资策略也将进行相应修改,转型后的投资策略拟修改为:  
“本基金充分发挥基金管理人研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,在经济转型升级大背景下,深入研究消费服务行业的发展趋势,积极挖掘不同行业和子行业景气度变化下的个股投资机会,通过团队对个股深入的基本面研究和细致的实地调研,精选个股,以谋求超额收益。  
1.资产配置  
本基金将根据“自上而下”的定性和定量分析相结合形成对不同类型资产市场的预测和判断,确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等各类资产之间的动态调整,并据此合理配置各类资产风险收益特征的对标资产。在基金合同约定的范围内动态调整组合中各类资产的比例,以规避或控制市场风险,提高基金

收益率。  
2.股票投资策略  
(1)消费服务行业的范畴  
消费服务行业指为社会大众提供各种有形产品和无形服务的行业,考虑到消费服务行业未来的发展趋势和方向,本基金对于消费服务行业范畴界定为大消费服务概念,在目前的社会和经济背景下,消费服务行业可以分为传统的消费服务行业和新兴消费服务行业。  
传统消费服务行业是指那些产品或服务在市场上存续时间较长的,形成了一定的消费基础和消费习惯的行业,主要包括食品饮料、医药生物、纺织服装、商业零售、家电、轻工、餐饮旅游、农林牧渔、汽车、电子、传媒等行业。  
随着人口结构、居民生活方式的变化,在经济转型、技术创新、移动互联网兴起,消费群体结构变化的大环境下,不断涌现出新的消费产品或服务模式,比如可穿戴设备、消费电子、电商、体育教育产业等,这些新兴消费领域未来仍会不断涌现,与此相关的新兴消费行业也在本基金定义的消费服务行业范畴内。  
未来,为了适应经济社会发展的需要,本基金管理人可根据整体经济、行业的发展变化,动态调整对于消费服务行业范畴的定义。  
(2)行业配置  
本基金主要通过通过对消费服务各子行业的基本情况、国家政策、行业整合机会、行业市场表现、主题投资机会以及子行业的估值情况进行综合考察,基于对各子行业的发展前景和整体投资机会的分析进行子行业之间的合理配置和灵活调整。  
(3)股票选择  
本基金充分发挥研究团队自下而上的选股能力,基于对个股深入的基本面研究和细致的实地调研,精选股票构建股票投资组合,具体分以下几个层次:  
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公司,构建备选股票池。主要筛选标准包括:  
●盈利能力指标(如P/E、P/Cash Flow、P/FCF、P/S、P/EBIT等)  
●经营效率指标(如ROE、ROA、Return on operating assets等)  
●财务状况指标(如D/A、流动比率等)  
2)价值评估  
股票估值水平的高低将最终决定投资回报率的高低。由于驱动公司价值创造的因素不同,本基金将借鉴市场通用估值理念,针对不同类型公司及公司发展中所处的不同阶段,采用不同的估值评估指标(如P/B、EV/EBITDA、DCF模型等)对公司的内在价值进行评估,筛选出估值具有吸引力的公司作为投资目标。  
最后,本基金根据对个股价值的评估和市场机会的判断构建股票组合,其中投资于消费服务类行业的公司股票不低于非现金基金资产的80%。  
3.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。本基金的投资策略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债券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,本基金管理人从宏观经济运行趋势及其对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。  
4.权证投资  
本基金的投资策略以权证的市值分析为基础,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手段,充分挖掘证券资产的收益性、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。  
5.资产支持证券投资  
本基金投资于资产支持证券将综合考虑运用久期管理、收益率曲线、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较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。  
6.股指期货投资  
本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的。本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的近期货合约。本基金在进行股指期货投资时,将通过证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。  
基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程,确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作,并明确相关岗位职责。此外,基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组,并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。”  
4.业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为:“沪深300行业分层等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。”  
沪深300行业分层等权重指数由中证指数有限公司编制和计算,沪深300行业分层等权重指数与沪深300指数拥有相同的成份股。不同的是,沪深300指数采用自流通市值加权法,而沪深300行业分层等权重指数采用了行业分层等权重加权,具体做法是:它先将行业权重,然后将其行业内个股市值、沪深300行业分层等权重指数展现出了与沪深300指数不同的风险收益特征,以满足投资者日益多元化的投资选择。  
由于本基金业绩优于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,因此本基金业绩比较基准中同时加入了银行活期存款利率(税后)。本基金认为,该业绩比较基准目前能够真实地反映本基金的风险收益特征。如果今后本基金所跟踪的目标指数被中证指数有限公司停止发布,或由其他指数替代,或基于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数;或者今后证券市场中有其他代表性更强的业绩比较基准推出时,本基金管理人将在征得基金托管人同意的情况下,履行适当程序后实际调整变更基金业绩的标的指数和业绩比较基准。  
转型后的业绩比较基准拟修改为:“85%×中证内地消费主题指数+15%×中信标普国债指数  
其中股票投资比较基准为中证内地消费主题指数,债券投资比较基准为中信标普国债指数。  
本基金股票部分主要投资于消费服务行业股票,中证内地消费主题指数从中证800成份股中,选取可选消费、主要消费板块中市值最大的50只消费类股票组成,主要覆盖食品饮料、交通运输、商业贸易、农林牧渔、纺织服装、医药生物等行业,反映沪深A股市场消费主题类公司股票的整体表现,较为适合作为本基金投资组合的业绩比较基准。  
如果上述业绩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、且更能表征本基金风险收益特征的指数,则本基金管理人可与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,无需召开基金份额持有人大会。  
5.风险收益特征  
本基金的风险收益特征为:“本基金属于股票基金,风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,同时本基金为指数型基金,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。”  
转型后的风险收益特征拟修改为:“本基金是一只股票型基金,其预期风险与预期收益均高于混合型基金、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。”  
6.鉴于转型后进行了修改,投资决策依据和投资流程也不再适用,需进行相应修改,转型后的投资决策依据和投资流程拟修改为:  
“1.投资决策依据  
(1)国家有关法律法规和基金合同的有关规定;  
(2)公司投资及风险控制政策;  
(3)宏观经济形势、证券市场运行环境和走势,以及上市公司的基本面;  
(4)投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系,本基金将在承担适度风险的范围,内,选择收益风险匹配最佳的品种进行投资。  
2.投资决策机制  
本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会的主要职责是对基金的资产配置提出指导性意见,审批重大单项投资决策,审视投资组合风险状况等。投资决策委员会是投资决策委员会的的执行代表。  
基金经理的主要职责是在投资决策委员会确定的资产配置范围内构建和调整投资组合,并向中央交易室下达投资指令。  
中央交易室负责交易执行和一线监控,通过严格的交易制度和实时的一线监控功能,保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高度的执行。  
3.投资管理流程  
投资决策委员会是本基金的最高决策机构,投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题召开讨论,基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作,又责任明确,在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的投资管理程序如下:  
(1)研究部宏观分析、策略分析、行业分析、行业分析师、信用分析师、数量分析师各自独立完成相应的研究报告,为投资决策提供依据;  
(2)投资决策委员会每月召开投资决策会议,对资产配置比例提出指导性意见,并讨论决策、债券的投资要点等;  
(3)基金经理根据投资决策委员会决议,依据宏观分析、策略分析、数量分析师的宏观经济分析和策略建议、行业分析师的行业分析和个股研究、信用分析师的债券市场研究和券种选择、数量分析师的定量投资策略研究,结合本基金产品特点及风险控制的要求,在权限范围内制定具体的投资组合方案;  
(4)基金经理根据基金投资组合方案,向中央交易室下达交易指令;  
(5)交易指令通过风控系统的自动合规核查后,由中央交易室执行,中央交易室对交易情况及时反馈;  
(6)基金经理对每日交易执行情况及时回顾,并审视基金投资组合的变动情况;  
(7)风险管理部定期完成有关投资风险监控报告,量化投资部定期完成基金业绩评估报告。  
4.投资于股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货等品种,有权根据市场变化和实际情况的需要,对上述投资管理程序作出调整。”  
7.关于投资目标、投资范围、投资策略进行了修改,原“七投资组合管理”不适用于转型后的新基金,将一并删去。  
8.投资限制  
本基金的投资限制是:  
“1.组合限制  
本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。本基金的投资组合将遵循以下限制:  
(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;  
(2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;  
(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的10%;  
(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;  
(5)本基金在全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;  
(6)本基金投资于沪深300行业分层等权重指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,持有现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%;

注:1.本表决票中“证件号码”,仅指基金份额持有人持有本基金基金份额的基金账号当前所使用的证件号码,基金份额持有人若因证件号码发生变更或其他原因不确定其基金账号当前所使用的证件号码,可拨打本基金管理人客户服务电话400-700-5000(免长途话费),(021)61055000咨询。  
2.请填明“同意”、“反对”或“弃权”,并在相应栏内划“√”,同一议案只能选择一项意见。  
3.基金份额持有人开立持有本基金的基金账户为多个的,若无法注明,以上表述应视为持有人承认其委托他人拥有全部基金份额所持有的本基金全部份额的授权作出上述表决。  
4.表决票未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票视为无效的表决票,不作为基金份额持有人大会表决票,请基金份额持有人重新作出授权,并以最新方式或最新授权为准,详细规则见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知(如有)。  
5.如本次基金份额持有人大会不能成功召开或者未能通过本次大会审议的议案,根据《基金法》和《基金合同》的有关规定,本基金可能会重新召开基金份额持有人大会。  
6.本公告的有关内容由交银施罗德基金管理有限公司负责解释。  
交银施罗德基金管理有限公司  
二〇一五年四月二十三日

附件四: 关于交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明

一、重要提示  
交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金(以下简称“交银施罗德300等权重基金”或“本基金”)于2012年11月7日成立并正式运作。鉴于目前市场环境变化,为更好地满足投资者需求,保护基金份额持有人的利益,提高产品的市场竞争力,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,提议召开本基金的基金份额持有人大会,审议本基金转型及基金合同修改事宜,将本基金转型为“交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金”,并对基金合同进行修订。  
本次交银施罗德300等权重指数基金转型方案及基金合同修改需经参加本次持有人大会的基金份额持有人及代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效,故本转型方案存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效,基金管理人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案,中国证监会对本次转型方案备案,不代表其对本次转型方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。  
二、基金转型方案要点  
(一)变更基金名称  
基金名称由“交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金”变更为“交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金”。  
(二)变更《基金合同》名称  
将《基金合同》的名称由“交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金合同”变更为“《交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金基金合同》”。  
(三)修改基金投资相关内容  
1