交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金（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：中国农业银行股份有限公司
二零一五年十一月

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】

交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2013年4月23日中国证券监督管理委员会证监许可【2013】581号文核准募集。本基金基金合同于2014年5月22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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

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。投资者在投资本基金前，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。投资者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；由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险；交易对手违约风险；投资本基金特有的其他风险等等。本基金是一只混合型基金，其长期平均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。

投资有风险，投资者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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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11月22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再处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美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

王亿军先生，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，学士学位。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。

张玲蕊女士，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中场部渠道经理，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，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；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。

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

李娜女士，美国宾夕法尼亚大学应用数学与计算科学硕士，5年证券行业经验。曾任国泰基金管理有限公司研究员。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司，曾任债券分析师、基金经理助理，2014年7月1日至2015年6月26日担任交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金基金经理助理，于2015年6月27日至2015年10月6日担任转型后的交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理（并自2015年10月7日至2015年11月6日代为履行该基金基金经理相关职责），2014年7月1日至2015年10月6日担任交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金经理助理（并自2015年10月7日至2015年11月6日代为履行该基金基金经理相关职责），2014年7月1日至2015年10月6日担任交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金经理助理（并自2015年10月7日至2015年11月6日代为履行该基金基金经理相关职责），2014年8月4日至2015年10月6日担任交银施罗德双利债券证券投资基金基金经理助理（并自2015年10月7日至2015年11月6日代为履行该基金基金经理相关职责），2015年5月29日至2015年10月6日担任交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金经理助理（并自2015年10月7日至2015年11月6日代为履行该基金基金经理相关职责），2014年7月1日至2015年7月31日担任交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2015年5月15日至2015年7月31日担任交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2015年8月4日起担任交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、交银施罗德多策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理至今。

历任基金经理

项廷锋先生，2014年6月3日至2015年10月6日任本基金基金经理。

李永兴先生，2014年5月22日至2015年5月30日任本基金基金经理。

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）

张鸣羽（研究部总经理）

齐皓（跨境投资总监、投资经理）

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2015年11月22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：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人：刘士余
成立日期：2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号
注册资本：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-66060069
传真：010-68121816
联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营，可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《金球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“金牌理财”TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到2015年9月30日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共306只。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

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

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

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；业务管理实行严格的复核、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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

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。

机构名称：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：傅毅
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、本基金A类基金份额前端基金份额的申购、赎回、定期定额投资、转换等业务、本基金C类基金份额的申购、赎回等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上直销交易平台网址：www.fund001.com，www.bocomschroder.com。

2、代销机构

本基金A类基金份额除直销机构外的其他场外销售机构：

（1）中国农业银行股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人：刘士余
传真：（010）85109219
客户服务电话：95599
网址：www.abchina.com

（2）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

（3）招商银行股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道7088号
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：李建红
电话：（0755）83198888
传真：（0755）83195109
联系人：邓炳鹏
客户服务电话：95555
网址：www.cmbchina.com

（4）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）65560827
联系人：丰靖
客户服务电话：95558
网址：bank.ecitic.com

（5）光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
电话：（021）22169999
传真：（021）22169134
联系人：刘晨
客户服务电话：10108998
网址：www.ebscn.com

（6）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

（7）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

（8）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

（9）申万宏源证券有限公司
住所：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
法定代表人：李梅
电话：（021）33389888
联系人：李清怡
客户服务电话：95523或4008895523
网址：www.swyg.com

（10）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

（11）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

（12）申万宏源西部证券有限公司
住所：新疆乌鲁木齐市建设路2号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号宏源证券
法定代表人：冯茂
电话：（010）88085858
传真：（010）88085195
联系人：李巍
客户服务电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

（13）长江证券股份有限公司
住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
电话：（027）65799999
传真：（027）85481900
联系人：李良
客户服务电话：95579或4008-888-999
网址：www.95579.com

（14）齐鲁证券有限公司
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

（15）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

（16）长城证券股份有限公司
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

（17）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

（18）瑞银证券有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人：程宜荪
电话：（010）58328112
传真：（010）58328740
联系人：牟冲
客户服务电话：400-887-8827
网址：www.ubssecurities.com

（19）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

（20）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

（21）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

（22）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

（23）华融证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市西城区金融大街8号
法定代表人：宋德清
电话：（010）58568235
传真：（010）58568062
联系人：黄恒
客户服务电话：（010）58568118
网址：www.hrsec.com.cn

（24）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

（25）联讯证券股份有限公司
住所：惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址：惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
法定代表人：徐刚
电话：（021）33606736
传真：（021）33606760
联系人：陈思
客户服务电话：95564
网址：www.lxzq.com.cn

（26）华西证券股份有限公司
住所：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人：杨炯洋
电话：（028）86135991
传真：（028）86150400
联系人：周志勤
客户服务电话：95584
网址：www.hx168.com.cn

（27）深圳众禄基金销售有限公司
住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
电话：（0755）33227953
传真：（0755）33227951
联系人：汤素娜
客户服务电话：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn，www.jjmmw.com

（28）上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
电话：（021）20691832
传真：（021）20691861
联系人：单丙烨
客户服务电话：400-820-2899
网址：www.erichfund.com

（29）上海好买基金销售有限公司
住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人：杨文斌
传真：（021）68596916
联系人：薛年
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

（30）诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼
法定代表人：汪静波
电话：（021）38600735
传真：（021）38509777
联系人：方成
客户服务电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com

（31）和讯信息科技有限公司
住所：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
电话：（021）20835789
传真：（021）20835879
联系人：周轶
客户服务电话：4009200022
网址：http://licaike.hexun.com/

（32）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

（33）杭州数米基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
电话：（0571）28829790，（021）60897869
传真：（0571）26698533
联系人：周嫣旻
客户服务电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn

（34）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层
法定代表人：陈操
电话：（010）58325395
传真：（010）58325282
联系人：刘宝文
客户服务电话：400-850-7771
网址：http://8.jrj.com.cn/

（35）北京展恒基金销售股份有限公司
住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人：闫振杰
电话：（010）59601366-7024
传真：（010）62020355
联系人：马林
客户服务电话：400-888-6661
网址：www.myfund.com

（36）一路财富（北京）信息科技有限公司
住所：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座22层2208
法定代表人：吴雪秀
电话：（010）88312877
传真：（010）88312099
联系人：苏昊
客户服务电话：400-001-1566
网址：http://www.yilucaifu.com/

（37）上海大智慧财富管理有限公司
住所：上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
办公地址：上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
法定代表人：申健
电话：（021）20219931
传真：（021）20219923
联系人：付江
客户服务电话：021-20219931
网址：https://8.gw.com.cn

（38）上海联泰资产管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3楼
法定代表人：燕斌
电话：（021）52822063
传真：（021）52975270
联系人：凌秋艳
客户服务电话：4000-466-788
网址：www.66zichan.com

（39）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
住所：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：沈伟桦
电话：（010）52855713
传真：（010）85894285
联系人：程刚
客户服务电话：400-6099-200
网址：www.yixinfund.com

（40）浙江同花顺基金销售有限公司
住所：浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼 2楼
法定代表人：凌顺平
电话：（0571）88311818
传真：（0571）88300423
联系人：吴强
客户服务电话：400-877-3772
网址：www.5ifund.com

（41）北京增财基金销售有限公司
住所：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
法定代表人：罗细安
电话：（010）67000988
传真：（010）670009888-6000
联系人：李皓
客户服务电话：400-001-8811
网址：www.zengcaiwang.com

（42）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
住所：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：林卓
电话：（0411）88891212
传真：（0411）84396536
联系人：薛长平
客户服务电话：4006411999
网址：www.taichengcaifu.com

（43）上海基煜基金销售有限公司
住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人：王翔
电话：（021）65370077
传真：（021）55085991
联系人：俞申昶
客户服务电话：（021）65370077
网址：www.jiyufund.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代理销售本基金，并及时公告。

本基金C类份额的销售机构暂仅包括本公司直销机构。

如有其他销售机构新增办理本基金C类份额的申购赎回等业务，请以本公司届时相关公告为准。

（二）基金登记机构

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：孙睿
经办律师：吕红、黎明

（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：交银施罗德周期回报灵活配置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

本基金以交银施罗德投资时钟分析框架为基础，结合基金管理人对宏观经济周期和金融市场运行趋势的判断，通过灵活的资产配置策略和积极主动的投资管理，在控制下行风险的前提下，力争为投资者提供长期稳健的投资回报。

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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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)。

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：股票资产占基金资产的0%-95%，股票资产按照基金所持有的股票市值以及买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）权证的投资比例不超过基金资产净值的3%；基金保留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%；基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%。

八、基金的投资策略

本基金充分发挥资产管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上，运用交银施罗德投资时钟分析框架，自上而下调整基金大类资产配置比例和股票行业配置比例，确定债券组合久期和债券类别配置；在严谨深入的股票和债券研究分析基础上，自下而上精选股票和债券。

1、资产配置

本基金通过对宏观经济运行周期、货币与财政政策形势、资金面供求变化、证券市场走势与估值水平等因素的定性分析和定量分析，自上而下调整大类资产配置比例，控制下行风险。具体而言，首先利用经济周期理论，对宏观经济的经济周期进行预测，在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断，运用交银施罗德投资时钟分析框架，确定基金资产在各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，动态调整组合中各类资产的比例，以规避或分散市场风险，提高基金收益率。

根据经济周期理论，一个宏观经济运行的周期可以分为滞胀、衰退、复苏和过热四个阶段，在经济周期的不同阶段，通货膨胀、利率水平和货币政策等对金融市场有着重要影响的因素往往表现出不同的规律，从而影响到不同大类金融资产的定价和市场表现。而实证研究也表明，经济周期与金融市场的表现往往呈现出很强的相关性，当宏观经济运行处于不同的阶段时，股票、债券和现金等各大类资产也体现出不同的市场表现。交银施罗德投资时钟分析框架依据经济周期和金融市场表现所呈现的相关关系，对周期不同阶段大类资产配置的调整提供指导和依据。

2、行业配置

不同行业受宏观经济周期、行业自身生命周期以及相关结构性因素的影响在不同时期表现往往具有明显差异。基金管理人采用多因素的定性与定量相结合的分析和预测方法，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，据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业，把握行业景气轮换带来的投资机会。

3、股票选择

本基金将综合运用交银施罗德股票研究分析方法和其它投资分析工具，充分发挥研究团队“自下而上”的主动选股能力，精选具有投资潜力的股票构建投资组合。具体分以下两个层次进行股票挑选：

（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）和财务状况指标（如D/A、流动比率等）。

（2）价值评估

在公司备选股票池基础上，本基金将进一步通过对备选上市公司翔实的案头分析和深入的实地调研，以定性与定量相结合的方法对公司价值进行综合评估，构建股票组合。其中本基金将重点关注具以下特征的优质上市公司：

①公司治理结构良好，管理规范，信息透明；

②主营业务鲜明，盈利能力强，收入和利润稳定增长；

③公司具有质量优良的成长性；

④公司财务状况良好，具备一定的规模优势和较好的抗风险能力；

⑤公司在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相当的核心竞争优势，有良好的市场知名度和较好的品牌效应，处于行业龙头地位。

对上述重点上市公司进行内在价值的评估和成长性跟踪研究，在明确的价值评估基础上精选优秀质地的投资标的构建股票组合。

4、债券投资

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

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

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。

7、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