

交银施罗德基金管理有限公司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

(2017年生效)

协议中的权利、义务,以及相应的债权债务关系和法律责任。中国银证储蓄银行股份有限公司(以下简称“托管人”)为中国银证储蓄银行股份有限公司,托管人按照《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》及中国证监会相关规定履行托管职责。

2. 主要人员情况
中国银证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、运营稽核处等,各业务处均配备有专门从事基金托管业务的从业人员,以上人员均具备从业资格,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
截至2017年9月30日,中国银证储蓄银行经中国证监会和中国银证储蓄银行监督管理委员会核准,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,中国银证储蓄银行经中国银证储蓄银行监督管理委员会批准,获得保险资金托管资格。中国银证储蓄银行坚持以客户为中心,以为资产管理机构提供、优化专业托管服务、提升托管业务服务水平、提升托管管理水平、健全内部控制体系、运作高效的业务处理模式,为“大基金”机构投资者和公募基金管理机构提供安全、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2017年9月30日,中国银证储蓄银行托管的证券投资基金共81只。至今,中国银证储蓄银行已形成涵盖证券投资基金托管的证券投资基金管理计划、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3431.72亿元人民币。

(二)基金托管人的内部控制制度
1. 内部控制目标
作为基金托管人,中国银证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,严格监控,确保所托管的基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整,及时、保护基金基金份额持有人的合法权益。

2. 内部控制组织结构
中国银证储蓄银行设有风险控制委员会,负责全行风险管理及内部控制工作,对托管业务的处理流程进行控制与指导,并负责专项审计部门监督检查制度,配备专职内控监督检查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职能和内控职责。

3. 内部控制制度和措施
托管业务具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位描述、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;业务操作实行严格复核、交叉复核、检查制度,投行业务实行集中授权管理;严格保密,实行防火墙管理;资产托管专户与托管人其他业务系统严格分离;专项审计,封闭管理,实施全程监控;业务信息通过专线系统传输,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统成熟、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运用基金资产的投资方法和程序
1. 监督方法
依照《基金法》及其他相关法律法规的有关规定,监督所托管基金的投资运作,严格按照法律法规及其他基金合同规定,对基金管理人运用基金资产的投资比例、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,并及时报告中国证监会。

(四)内部控制制度的执行情况
中国银证储蓄银行在报告期内严格执行了上述内部控制制度,确保了托管业务的规范操作和顺利进行,保障了基金财产的安全完整,确保了有关信息的真实、准确、完整,及时、保护基金基金份额持有人的合法权益。

2. 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 | - | - |
| 2 | 其中:股票 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 674,942,900.00 | 98.15 |
| 4 | 其中:债券 | 674,942,900.00 | 98.15 |
| 5 | 资产支持证券 | - | - |
| 6 | 贵金属投资 | - | - |
| 7 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 8 | 买入返售金融资产 | 200,000.00 | 0.03 |
| 9 | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 10 | 银行存款和拆借资产合计 | 313,020.00 | 0.05 |
| 11 | 其他资产 | 12,204,420.94 | 1.77 |
| 12 | 合计 | 687,669,380.93 | 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港股通股票。

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
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 | 29,968,000.00 | 5.54 |
| 4 | 其中:政策性金融债 | 29,968,000.00 | 5.54 |
| 5 | 企业债券 | 19,800,000.00 | 3.66 |
| 6 | 企业短期融资券 | 110,331,000.00 | 20.40 |
| 7 | 中期票据 | 438,067,300.00 | 81.00 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 银行存款 | 76,796,000.00 | 14.20 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 674,942,900.00 | 124.90 |

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五名债券投资明细
持有A类基金份额的投资者因红利自动再投资而产生的A类基金份额,不取相应的申购费用。

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行申购费率优惠,具体包括:
1) 全佣社会保障基金;
2) 列入社会公益的慈善方社会保障基金;
3) 企业年金计划以及集合计划;
4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划;
5) 养老基金养老金客户。

5. 报告期内基金管理人经中国证监会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临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定对中国证监会备案。
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类基金份额申购费率 |
|----------------|------------|
| 50万元以下 | 0.25% |
| 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) | 每笔免收500元 |

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
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,在本报告期内报告期内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,未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 | 12,204,420.94 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 1500 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,204,420.94 |

(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受争议情况的说明
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、基金的投资
基金业绩截止日为2017年9月30日,所载财务数据未经审计。
本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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金管理人直销柜台包括个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下列列表。

1. 基金申购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 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|------------|-------|----------|-----------|--------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.06% | 0.03% | -0.15% | 0.03% | 1.10% | 0.00% |
| 2017年上半年 | 1.89% | 0.06% | -2.11% | 0.08% | 4.00% | -0.02% |
| 2016年度 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 0.28% | 0.03% | -1.73% | 0.21% | 2.01% | -0.18% |

A类基金份额
过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差

①-③
②-④

过去三个月
2017年上半年
2016年度
自基金合同生效起至今

净值增长率
净值增长率标准差
业绩比较基准收益率
业绩比较基准收益率标准差