

信息披露 Disclosure

中国证券报

(上接B042版)

网址:www.998fund.com
(7) 桂上富投资顾问有限公司
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:李锐章

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.gsfesafe.com

(76) 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弄大五道口广场1号楼27层

法定代表人:胡洪军
电话:(021) 33356392
传真:(021) 63653736
联系人:茅青
客户服务电话:400-876-5716
网址:www.cmciwm.com

(77) 上海万得基金管理有限公司
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

(78) 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
法定代表人:李修峰
电话:(010) 69013828
传真:(010) 69013707
联系人:王芳芳
客户服务电话:010-59013842
网址:http://www.wanjiwealth.com/
(79) 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
电话:(021) 50810687
传真:(021) 58300279
联系人:李娟
客户服务电话:400-821-0203
网址:www.wacaijin.com

(80) 鑫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
法定代表人:赵学军
电话:(021) 38789658
传真:(021) 68890023
联系人:王宫
客户服务电话:400-102-8890
网址:www.harvestwmcn.com

(81) 南京苏宁基金销售有限公司
住所:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:王峰
电话:025-69669966
传真:025-69996699
联系人:冯鹏
客户服务电话:95177
网址:www.smjinfund.com

(82) 北京百度百盈基金销售有限公司
住所:北京市海淀区六号桥10号1幢1层101
办公地址:北京市海淀区信息路甲9号科大国际
法定代表人:张旭阳
电话:010-6192703
传真:010-61951007
联系人:霍博华
客户服务电话:400-817-5666
网址:www.baiyingfund.com

(83) 北京磨盘华泽咨询有限公司
住所:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2幢236室
办公地址:北京市延庆区东三环北路38号院1号泰康金融中心38层
法定代表人:张冠宇
电话:(010) 85870662
传真:(010) 69200800
联系人:刘微微
客户服务电话:400-811-9868
网址:www.rdcfund.com

(84) 上海华夏财富投资管理有限公司
住所:上海市虹口区飞虹路687号1幢2楼268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:吴淮平
电话:010-88066632
传真:010-63136184
联系人:张静怡
客户服务电话:400-817-5666
网址:www.amfortune.com

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基金,并及时公告。

(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) 60938782
传真:(010) 60938907
联系人:赵亦清
(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60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) 31550666
传真:(021) 31550600
联系人:黎明
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:上海市浦东新区陆家嘴环路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:薛蔚、朱宏宇

四、基金的名称
本基金名称:交银施罗德定期支付月月丰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

本基金具有较高息票率的债券,以获取稳定的利息收入,并通过适当参与股票市场,力争实现基金资产的长期增值。

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,货币市场工具,权证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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于固定收益类资产的比例不低

于基金资产净值的90%,固定收益类资产包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据,可转换债券及可分离债转股、资产支持证券、次级债、债券回购等金融工具,对股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产净值的20%;其中现金或到期日在一年以内(含一年)的银行存款的投资比例合计不低于基金资产净值的5%,现金不包括结算准备金,存出保证金和应收申购款等;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%。

八、基金的投资策略
本基金充分发掘基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场走势的基础上,通过对经济周期所处的发育阶段及其走势的分析和判断以及不同资产类别的预期表现,对基金资产配置进行动态调整,在有效控制投资组合风险的基础上,提高基金资产风险运作后的收益。

1、资产配置策略
本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上,并在基金合同约定的资产配置范围内以投资策略为导向,通过对经济周期所处的发育阶段及其走势的分析和判断以及不同资产类别的预期表现,对基金资产配置进行动态调整,在有效控制投资组合风险的基础上,提高基金资产风险运作后的收益。

2、债券投资策略
本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场走势的基础上,通过对经济周期所处的发育阶段及其走势的分析和判断以及不同资产类别的预期表现,对基金资产配置进行动态调整,在有效控制投资组合风险的基础上,提高基金资产风险运作后的收益。

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资产支持证券明细
本基金报告期末未持有资产支持证券。

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细
本基金报告期末未持有权证。

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明细
本基金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
本基金报告期末未持有权证。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有权证。

10、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有国债期货。

11、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
(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处罚和处罚。

(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
本基金报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细变化来调整投资组合的头寸。

在考察收益率曲线的基础上,本基金将确定采用子弹策略、哑铃策略或梯形策略,以及从收益率曲线的形状中获利。一般而言,当收益率曲线变陡时,将采用子弹策略;当收益率曲线变平或平行移动时,则采用哑铃策略;在预期收益率不变或平行移动时,则采用梯形策略。

(4) 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以投资标的,从而获取收益超越回购资金成本(即回购利差)的套利价值。

(5) 信用债券投资策略
信用债券同时承载了利率风险与信用风险,而信用风险对信用债券表现的影响大于利率风险。具体而言,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、咨询行业中介等形式,“自上而下”地分析宏观经济运行趋势、行业(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。

②信用债券评级
信用评级将对信用债券的信用等级、信用风险、信用利差、信用利差波动率等进行评价,并根据评价结果对信用债券进行筛选。

③信用债券投资
本基金将通过深入研究,提前偿还率、资产负债结构及资产池资产所在行业景气状况,预测资产池未来现金流变化;研究资产池资产所在行业景气状况,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响,进而密切关注流动性和收益率的变化。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。

(4) 可转换债券投资策略
可转换债券是兼具股权和债权双重特征的投资品种。本基金对于可转换债券的投资研究将依托于公司研究团队对标的股票的研究,在此基础上,通过转换机制,充分考虑转换债后目标转换债券的股价波动率可能出现的变化,对目标转换的股性进行合理定价。对于可转换债券的研究,本基金将引进公司信用评级指标体系,对可转换债券的发行主体及标的债券进行信用评级,并在信用评级的基础上对其进行合理定价。通过对标的转换债与债权的合理定价,力求寻找出被市场低估的品种,构建本基金可转换债券的投资组合。

3、股票投资策略
本基金将通过严格控制投资风险前提下适度参与股票资产投资。本基金将综合运用股票估值方法和其它投资分析工具,充分发挥研究团队主动选股优势,自下而上精选具有投资潜力的股票构建投资组合。具体而言,本基金股票投资策略包括新股投资策略和股票二级市场投资策略。

(1) 股票二级市场投资策略
本基金将通过分析影响股票一级市场股价的因素和相关市场风险收益特征的股票,把握股票市场的趋势和股票市场的动向,从而选择具有良好成长前景的行业精选具有投资潜力的股票构建投资组合,有效提升基金的整体收益。

(2) 新股投资策略
本基金将通过分析影响股票一级市场股价的因素和相关市场风险收益特征的股票,把握股票市场的趋势和股票市场的动向,从而选择具有良好成长前景的行业精选具有投资潜力的股票构建投资组合,有效提升基金的整体收益。

(3) 股票二级市场投资策略
本基金将通过分析影响股票一级市场股价的因素和相关市场风险收益特征的股票,把握股票市场的趋势和股票市场的动向,从而选择具有良好成长前景的行业精选具有投资潜力的股票构建投资组合,有效提升基金的整体收益。

(4) 融资融券投资策略
可转换债券是兼具股权和债权双重特征的投资品种。本基金对于可转换债券的投资研究将依托于公司研究团队对标的股票的研究,在此基础上,通过转换机制,充分考虑转换债后目标转换债券的股价波动率可能出现的变化,对目标转换的股性进行合理定价。对于可转换债券的研究,本基金将引进公司信用评级指标体系,对可转换债券的发行主体及标的债券进行信用评级,并在信用评级的基础上对其进行合理定价。通过对标的转换债与债权的合理定价,力求寻找出被市场低估的品种,构建本基金可转换债券的投资组合。

4、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债券投资组合
本基金报告期末未持有债券投资。

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组合
本基金报告期末未持有债券投资。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

10、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

11、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

12、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

13、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

14、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

15、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

16、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

17、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

18、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

19、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

20、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

21、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

22、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

23、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

24、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

25、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

26、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

27、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

28、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

29、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

30、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

31、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

32、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

33、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

34、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

35、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

36、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

37、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

38、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

39、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

40、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

41、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

42、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

43、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

44、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

45、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

46、报告期末按公允价值占基金资产净值比例说明
本基金报告期末未持有债券投资。

47、报告期末按