（上接B004版）

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

| 代码 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002690 | 美亚光电 | 260,000 | 9,170,200.00 | 2.84 |
| 2 | 002008 | 大族激光 | 500,000 | 8,670,000.00 | 2.68 |
| 3 | 300137 | 先河环保 | 260,000 | 5,423,600.00 | 1.68 |
| 4 | 300104 | 乐视网 | 100,000 | 4,390,000.00 | 1.36 |
| 5 | 300070 | 碧水源 | 143,983 | 4,211,502.75 | 1.30 |
| 6 | 000768 | 中航飞机 | 260,000 | 2,737,800.00 | 0.85 |
| 7 | 600571 | 信雅达 | 126,324 | 2,462,054.76 | 0.76 |
| 8 | 601888 | 中国国旅 | 50,000 | 1,652,000.00 | 0.51 |
| 9 | 002049 | 同方国芯 | 50,000 | 1,187,500.00 | 0.37 |
| 10 | 300241 | 瑞丰光电 | 80,000 | 1,167,200.00 | 0.36 |

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 | 40,172,000.00 | 12.42 |
| | 其中:政策性金融债 | 40,172,000.00 | 12.42 |
| 4 | 企业债券 | 184,086,368.80 | 56.92 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 30,311,000.00 | 9.37 |
| 7 | 可转债 | 221,633,412.56 | 68.53 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 476,202,781.36 | 147.24 |

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 | 113005 | 平安转债 | 240,000 | 25,636,800.00 | 7.93 |
| 2 | 113003 | 重工转债 | 220,000 | 24,983,200.00 | 7.72 |
| 3 | 110015 | 石化转债 | 230,000 | 24,833,100.00 | 7.68 |
| 4 | 110024 | 隧道转债 | 220,000 | 23,738,000.00 | 7.34 |
| 5 | 110023 | 民生转债 | 250,000 | 23,200,000.00 | 7.17 |

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除中国石化（证券代码：600028）外，未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券之一石化转债（证券代码：110015）的发行主体中国石化于2014年1月12日公告称，国务院批复同意国务院事故调查组对于公司位于青岛经济技术开发区的东黄复线原油管道发生破裂，导致原油泄漏并发生爆炸，导致周边行人、居民、抢险人员伤亡的重大事故的处理结果，对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪律处分，对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任，并由公司赔偿此次事故的直接经济损失75172万元。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资特别是重仓个券/可转债的投资有严格的投资决策流程控制。本基金在对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上，严格执行公司个券审核流程。在对该证券的持有过程中研究员密切关注转债发行人动向。在上述事故发生时及时分析其对投资决策的影响，经过分析认为此事故对转债发行人财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，所以不影响对该转债基本面和投资价值的判断。

（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 | 44,616.78 |
| 2 | 应收证券清算款 | 971,231.89 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 8,287,986.97 |
| 5 | 应收申购款 | 92,612.54 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,396,448.18 |

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113005 | 平安转债 | 25,636,800.00 | 7.93 |
| 2 | 113003 | 重工转债 | 24,983,200.00 | 7.72 |
| 3 | 110015 | 石化转债 | 24,833,100.00 | 7.68 |
| 4 | 110024 | 隧道转债 | 23,738,000.00 | 7.34 |
| 5 | 110023 | 民生转债 | 23,200,000.00 | 7.17 |
| 6 | 110018 | 国电转债 | 21,247,696.00 | 6.57 |
| 7 | 113002 | 工行转债 | 21,080,000.00 | 6.52 |
| 8 | 110020 | 南山转债 | 14,256,000.00 | 4.41 |
| 9 | 110016 | 川投转债 | 10,330,400.00 | 3.19 |
| 10 | 127002 | 徐工转债 | 2,818,890.00 | 0.87 |
| 11 | 127001 | 海直转债 | 2,591,500.00 | 0.80 |
| 12 | 125089 | 深机转债 | 1,659,367.89 | 0.51 |

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300137 | 先河环保 | 5,423,600.00 | 1.68 | 重大事项 |

（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2014年6月30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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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/B类 | 过去三个月 | 7.84% | 0.49% | 2.28% | 0.12% | 5.56% | 0.37% |
| | 2014年上半年 | 5.77% | 0.56% | 2.95% | 0.13% | 2.82% | 0.43% |
| | 2013年度 | 4.19% | 0.68% | -3.95% | 0.17% | 8.14% | 0.51% |
| | 2012年度 | 9.37% | 0.40% | 1.25% | 0.13% | 8.12% | 0.27% |
| | 2011年度(自基金合同生效日起至2011年12月31日) | 0.80% | 0.28% | 1.72% | 0.17% | -0.92% | 0.11% |
| C类 | 过去三个月 | 7.72% | 0.49% | 2.28% | 0.12% | 5.44% | 0.37% |
| | 2014年上半年 | 5.53% | 0.56% | 2.95% | 0.13% | 2.58% | 0.43% |
| | 2013年度 | 3.85% | 0.68% | -3.95% | 0.17% | 7.80% | 0.51% |
| | 2012年度 | 8.66% | 0.40% | 1.25% | 0.13% | 7.41% | 0.27% |
| | 2011年度(自基金合同生效日起至2011年12月31日) | 0.70% | 0.28% | 1.72% | 0.17% | -1.02% | 0.11% |

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

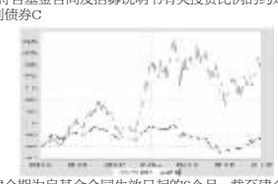
交银施罗德双利债券证券投资基金

份额累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2011年9月26日至2014年6月30日）

1. 交银双利债券A/B

2. 交银双利债券C



注：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、基金财产拨划支付的银行费用；

4、基金合同生效后的基金信息披露费用；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

7、基金的证券交易费用；

8、本基金从C类基金份额的基金财产中计提销售服务费；

9、证券账户开户费用和银行账户维护费；

10、依法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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数，本基金年管理费率为0.7%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内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，支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数，本基金年托管费率为0.2%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(3)C类基金份额的销售服务费

本基金A类和B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×年销售服务费率÷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

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销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，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)除管理费、托管费和C类基金份额销售服务费之外的基金费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

（1）申购费

投资人申购A类基金份额收取前端申购费用，即在申购时支付申购费用，申购费率按每笔申购申请单独计算。投资人申购B类基金份额收取后端申购费用，即在赎回时才支付相应的申购费用，该费用随基金份额的持有时间递减。投资人申购C类基金份额不收取申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。目前场内交易只支持A类基金份额的申购。

A/B类基金份额的申购费用由A/B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，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金A类基金份额的申购费率如下：

| 申购金额(含申购费) | A类基金份额前端申购费率 |
|---|---|
| 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(含)以上 | 每笔交易1000元 |

本基金B类基金份额的申购费率如下：

| 持有期限 | B类基金份额后端申购费率 |
|---|---|
| 1年以内(含) | 1.0% |
| 1年—3年(含) | 0.6% |
| 3年—5年(含) | 0.4% |
| 5年以上 | 0 |

持有A/B类基金份额的投资人因红利自动再投资而产生的A/B类基金份额，不收取相应的申购费用。

本基金自2013年4月11日起，对通过本公司直销柜台申购本基金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，具体包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。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，本公司将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。

通过本公司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：

| 特定申购费率（A类基金份额） | 申购金额(含申购费) | 特定申购费率 |
|---|---|---|
| | 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1000元 |

有关养老金客户实施特定申购费率的具体规定以及活动时间如有变化，敬请投资人留意本公司发布的相关公告。

（2）申购份额的计算

（a）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）

申购份额=@

例一：某投资人投资100,000元申购本基金的A类基金份额（非网上交易），假设申购当日A/B类基金份额净值为1.040元，申购费率为0.8%，如果该投资人是场外申购，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）/1.040=95,390.72份

如果该投资人是场内申购，申购份额为95,390份，其余0.72份对应金额返回给投资人。

（b）B类基金份额的申购

申购总金额=申请总金额

申购份额＝[illegible]

当投资人提出赎回时，后端申购费用的计算方法为：

后端申购费用＝赎回份额×T日A/B类基金份额净值×后端申购费率

例二：某投资人投资100,000元申购本基金的B类基金份额，假设申购当日A/B类基金份额净值为1.040元，则其可得到的申购份额为：

申购份额＝100,000/1.040＝96,153.85份

即：投资人投资100,000元申购本基金的B类基金份额，假设申购当日A/B类基金份额净值为1.040元，则可得到96,153.85份基金份额，但其在赎回时需根据其持有时间按对应的后端申购费率交纳后端申购费用。

（c）C类基金份额的申购

如果投资人选择申购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：某投资人投资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1.040元，则其可得到的申购份额为：

申购份额＝100,000/1.040＝96,153.85份

即：投资人投资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1.040元，则其可得到96,153.85份C类基金份额。

（3）赎回费

赎回费用由A/B类基金份额赎回人承担，赎回费用的25%归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。投资人赎回A类和B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，赎回C类基金份额不收取赎回费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金A/B类基金份额的赎回费率如下：

| 持有期限 | 赎回费率 |
|---|---|
| 1年以内(含) | 0.1% |
| 1年—2年(含) | 0.05% |
| 2年以上 | 0 |

（4）赎回金额的计算

（a）A类基金份额的赎回

如果投资人赎回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/B类基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T日A/B类基金份额净值-赎回费用

例四：某投资人赎回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/B类基金份额净值是1.016元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用=100,000×1.016×0.1%=101.60元

赎回金额=100,000×1.016-101.60=101,498.40元

即：投资人赎回100,000份A类基金份额，假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.016元，则其可得到的赎回金额为101,498.40元。

（b）B类基金份额的赎回

如果投资人赎回B类基金份额，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总额＝赎回份额×T日A/B类基金份额净值

后端认（申）购费用＝赎回份额×认（申）购日基金份额净值×后端认（申）购费率

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额＝赎回总额－后端认（申）购费用－赎回费用

例五：某投资人赎回100,000份B类基金份额，对应的后端申购费率是1.0%，赎回费率为0.1%，假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.016元，申购时的A/B类基金份额净值为1.010元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=100,000×1.016=101,600元

后端申购费用=100,000×1.010×1.0%=1,010.00元

赎回费用=101,600×0.1%=101.60元

赎回金额=101,600-1,010.00-101.60=100,488.40元

即：投资人赎回100,000份B类基金份额，对应的赎回费率为0.1%，假设赎回当日A/B类基金份额净值是1.016元，投资人对应的后端申购费率是1.0%，申购时的A/B类基金份额净值为1.010元，则其可得到的赎回金额为100,488.40元。

（c）C类基金份额的赎回

投资人赎回C类基金份额，赎回金额的计算方法如下：

赎回金额=赎回份数×赎回当日C类基金份额净值

例六：某投资人赎回100,000份C类基金份额，假设赎回当日C类基金份额净值是1.250 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=100,000×1.250=125,000 元

即：投资人赎回100,000份C类基金份额，假设赎回当日C类基金份额净值是1.250元，则其可得到的赎回金额为125,000元。

（5）转换费

（a）每笔基金转换视为一笔赎回和一笔申购，基金转换费用相应由转出基金的赎回费用及转出、转入基金的申购补差费用构成。

（b）转出基金的赎回费用

转出基金的赎回费用按照各基金最新的更新招募说明书及相关公告规定的赎回费率和计费方式收取，赎回费用的25%归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

（c）前端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从不收取申购费用的基金或前端申购费用低的基金向前端申购费用高的基金转换，收取前端申购补差费用；从前端申购费用高的基金向前端申购费用低的基金或不收取申购费用的基金转换，不收取前端申购补差费用。申购补差费用原则上按照转出确认金额对应分档的转入基金前端申购费率减去转出基金前端申购费率差额进行补差，转出与转入基金的申购补差费率按照转出确认金额分档，并随着转出确认金额递减。

（d）后端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从不收取申购费用的基金或后端申购费用低的基金向后端申购费用高的基金转换，不收取后端申购补差费用，但转入的基金份额赎回的时候需全额收取转入基金的后端申购费；从后端申购费用高的基金向后端申购费用低的基金或不收取申购费用的基金转换，收取后端申购补差费用，且转入的基金份额赎回的时候需全额收取转入基金的后端申购费。后端申购补差费用按照转出份额持有时间对应分档的转出基金后端申购费率减去转入基金后端申购费率差额进行补差。

（e）“网上直销交易平台”网上直销的申购补差费率优惠

为更好服务投资者，本基金管理人已开通基金网上直销业务，个人投资者可以通过“网上直销交易平台”办理基金转换业务，其中部分转换业务可享受转换费率优惠，优惠费率只适用于转出与转入基金申购补差费用，转出基金的赎回费用无优惠。可通过网上直销交易平台办理的转换业务范围及转换费率优惠的具体情况请参阅本基金管理人网站。

具体转换费率水平请参见本基金管理人网站（www.fund001.com，www.bocomschroder.com）列示的相关转换费率表或相关公告。

（f）基金管理人可以根据法律法规及基金合同的规定对上述收费方式和费率进行调整，并应于调整后的收费方式和费率在实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

（6）基金转换份额的计算公式

（a）前端收费模式下基金转换份额的计算公式及举例

转出确认金额=转出的基金份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金的赎回费=转出确认金额×对应的转出基金的赎回费率

转入确认金额=转出确认金额-转出基金的赎回费

转出与转入基金的申购补差费=转入确认金额×对应的转出与转入基金的申购补差费率/（1+对应的转出与转入基金的申购补差费率）

（注：对于适用固定金额申购补差费用的，转出与转入基金的申购补差费＝固定金额的申购补差费）

转入基金确认份额=（转入确认金额-转出与转入基金的申购补差费+A）/转换申请当日转入基金的基金份额净值

其中：

A为货币市场基金转出的基金份额按比例结转的账户当前累计待支付收益（仅限转出基金为货币市场基金的情形，否则A为0）。

转入基金确认份额的计算精确到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，误差部分归基金财产。

例一：某投资者持有交银趋势前端收费模式的基金份额100,000份，持有期半年，转换申请当日交银趋势的基金份额净值为1.010元，交银成长的基金份额净值为2.2700元。若该投资者将100,000份交银趋势前端基金份额转换为交银成长前端基金份额，则转入交银成长确认的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.010=101,000元

转出基金的赎回费=101,000×0.5%=505元

转入确认金额=101,000-505=100,495元

转出与转入基金的申购补差费=100,495×0/（1+0）=0元

转入基金确认份额=（100,495-0）/2.2700=44,270.93份

例二：某投资者持有交银增利A类基金份额1,000,000份，持有期一年半，转换申请当日交银增利A类基金份额的基金份额净值为1.0200元，交银趋势的基金份额净值为1.010元。若该投资者将1,000,000份交银增利A类基金份额转换为交银趋势前端基金份额（非网上交易），则转入交银趋势确认的基金份额为：

转出确认金额=1,000,000×1.0200=1,020,000元

转出基金的赎回费=1,020,000×0.05%=510元

转入确认金额=1,020,000-510=1,019,490元

转出与转入基金的申购补差费=1,019,490×0.5%/（1+0.5%）=5,072.09元

转入基金确认份额=（1,019,490-5,072.09）/1.010=1,004,374.17份

例三：某投资者持有交银增利C 类基金份额100,000份，转换申请当日交银增利C类基金份额净值为1.2500元，交银精选的基金份额净值为2.2700元。若该投资者将100,000份交银增利C类基金份额转换为交银精选前端基金份额 （非网上交易），则转入交银精选确认的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.2500=125,000元

转出基金的赎回费=0元

转入确认金额=125,000-0=125,000元

转出与转入基金的申购补差费=125,000×1.5%/（1+1.5%）=1,847.29元

转入基金确认份额=（125,000-1,847.29）/2.2700=54,252.30份

例四：某投资者持有交银货币A级基金份额100,000份，该100,000份基金份额未结转的待支付收益为61.52元，转换申请当日交银增利A/B类基金份额净值为1.2700元，交银货币的基金份额净值为1.00元。若该投资者将100,000份交银货币A级基金份额转换为交银增利A类基金份额（非网上交易），则转入确认的交银增利A类基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.00=100,000元

转出基金的赎回费=0元

转入确认金额=100,000-0=100,000元

转出与转入基金的申购补差费=100,000×0.8%/（1+0.8%）=793.65元

转入基金确认份额=（100,000-793.65+61.52）/1.2700=78,163.68份

（b）后端收费模式下基金转换份额的计算公式及举例

转出确认金额=转出的基金份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金的赎回费=转出确认金额×对应的转出基金的赎回费率

转入确认金额=转出确认金额-转出基金的赎回费

转出与转入基金的申购补差费=转入确认金额×对应的转出与转入基金的申购补差费率

转入基金确认份额=（转入确认金额-转出与转入基金的申购补差费+A）/转换申请当日转入基金的基金份额净值

其中：

A为货币市场基金转出的基金份额按比例结转的账户当前累计待支付收益（仅限转出基金为货币市场基金的情形，否则A为0）。

例一：某投资者持有交银趋势后端收费模式的基金份额100,000份，持有期一年半，转换申请当日交银趋势的基金份额净值为1.0200元，交银成长的基金份额净值为2.2700元。若该投资者将100,000份交银趋势后端基金份额转换为交银成长后端基金份额，则转入交银成长的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.250=125,000元

转出基金的赎回费=125,000×0.2%=250元

转入确认金额=125,000-250=124,750元

转出与转入基金的申购补差费=124,750×0=0元

转入基金确认份额=（124,750-0）/2.2700=54,955.95份

例六：某投资者持有交银先锋后端收费模式的基金份额100,000份，持有期一年半，转换申请当日交银先锋的基金份额净值为1.2500元，交银货币的基金份额净值为1.00元。若该投资者将100,000份交银先锋后端基金份额转换为交银货币，则转入交银货币的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.250=125,000元

转出基金的赎回费=125,000×0.2%=250元

转入确认金额=125,000-250=124,750元

转出与转入基金的申购补差费=124,750×1.2%=1497元

转入基金确认份额=（124,750-1497）/1.00=123,253.00份

例七：某投资者持有交银蓝筹后端收费模式的基金份额100,000份，持有期三年半，转换申请当日交银蓝筹的基金份额净值为0.8500元，交银增利B类基金份额的基金份额净值为1.0500。若该投资者将100,000份交银蓝筹后端基金份额转换为交银增利B类基金份额，则转入交银增利B类基金份额的基金份额为：

转出确认金额=100,000×0.850=85,000元

转出基金的赎回费=85,000×0=0元

转入确认金额=85,000-0=85,000元

转出与转入基金的申购补差费=85,000×0.2%=170元

转入基金确认份额=（85,000-170）/1.0500=80,790.48份

例八：某投资者持有交银货币A级基金份额100,000份，该100,000份基金份额未结转的待支付收益为61.52元，转换申请当日交银增利A类基金份额净值为1.2700元，交银货币的基金份额净值为1.00元。若该投资者将100,000份交银货币A级基金份额转换为交银增利B类基金份额，则转入交银增利B类基金份额的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.00=100,000元

转出基金的赎回费=0元

转入确认金额=100,000-0=100,000元

转出与转入基金的申购补差费=100,000×0.2%=170元

转入基金确认份额=（85,000-170）/1.0500=80,790.48份

例八：某投资者持有交银货币A级基金份额100,000份，该100,000份基金份额未结转的待支付收益为61.52元，转换申请当日交银增利A/B类基金份额净值为1.2700元，交银货币的基金份额净值为1.00元。若该投资者将100,000份交银货币A级基金份额转换为交银增利A类基金份额（非网上交易），则转入确认的交银增利A类基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.00=100,000元

转出基金的赎回费=0元

转入确认金额=100,000-0=100,000元

（7）网上直销的有关费率

本基金管理人已开通基金网上直销业务，个人投资者可以直接通过本公司网站的网上直销交易平台办理开户和本基金的申购、赎回、定期定额投资和转换等业务。本公司暂不开展网上直销本基金B类基金份额的认/申购业务，通过转托管转入网上直销账户的本基金B类基金份额只能只赎回或转出。通过网上直销交易平台办理本基金A类基金份额申购和定期定额投资业务的个人投资者将享受前端申购费率优惠，通过网上直销交易平台进行基金转换，从各基金招募说明书所载的零申购费率的基金转换入非零申购费率的基金，转出与转入基金的前端申购补差费率将享受优惠，其他费率标准不变。具体优惠费率请参见公司网站列示的网上直销交易平台申购、定期定额投资及转换费率表或相关公告。

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。

个人投资者通过本基金管理人网上直销交易平台申购本基金A类、C类基金份额的单笔最低金额为100元（含），单笔定期定额投资最低金额为100元（含）；单笔赎回份额不得低于100份，投资者可将其全部或部分基金份额转换成其它基金，单笔转换申请不受转入基金最低申购限额限制。

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。

（8）基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人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体上公告。

（9）基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和转换费率。

（三）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

（五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

**十四、对招募说明书更新部分的说明**

总体更新

本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

（一）更新了“重要提示”中相关内容。

（二）更新了“三、基金管理人”中相关内容。

（三）更新了“四、基金托管人”中相关内容。

（四）更新了“五、相关服务机构”中相关内容。

（五）更新了“八、基金份额的申购与赎回”中相关内容。

（六）更新了“九、基金的转换”中相关内容。

（七）更新了“十、基金的投资”中“基金投资组合报告”相关内容，数据截止到2014年6月30日。

（八）更新了“十一、基金的业绩”中相关内容，数据截止到2014年6月30日。

（九）更新了“二十一、托管协议的内容摘要”中相关内容。

（十）更新了“二十二、对基金份额持有人的服务”中相关内容。

（十一）更新了“二十三、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

二〇一四年十一月十日

---

证券代码:002526 证券简称:山东矿机 公告编号:2014-043

# 山东矿机集团股份有限公司 关于独立董事辞职的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

山东矿机集团股份有限公司（以下简称“公司”或“山东矿机”）董事会于?2014?年?11?月?6日收到公司独立董事许亚雄先生的书面辞职报告。许亚雄先生因国家政策原因申请辞去公司独立董事及董事会各委员会委员职务，辞职后许亚雄先生将不在公司担任任何职务。

根据中国证监会《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》、《公司法》、《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》等法律法规及《公司章程》的相关规定，许亚雄先生辞去独立董事职务导致公司独立董事人数少于董事会成员的三分之一，因此许亚雄先生的辞职报告将在公司选举出新任独立董事后方能生效。在此之前，许亚雄先生仍应当按照有关法律、行政法规和《公司章程》的规定继续履行职责。公司董事会将按照相关规定，尽快完成独立董事空缺的补选和相关后续工作。

许亚雄先生在担任公司独立董事期间，认真履行独立董事的职责，勤勉尽责，为公司规范运作和健康发展发挥了积极作用。在此，公司董事会对许亚雄先生担任公司独立董事期间所做出的贡献表示衷心的感谢！

特此公告。

山东矿机集团股份有限公司

董事会

2014 年11月7日

---

证券代码:002504 证券简称:东光微电 公告编号:2014-092

# 江苏东光微电子股份有限公司 关于大股东质押本公司股票的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

江苏东光微电子股份有限公司（以下简称“本公司”）于2014年11月7日接到公司大股东北京弘高慧目投资有限公司（以下简称“弘高慧目公司”）的通知，弘高慧目公司将其持有的本公司有限售条件流通股中的70,000,000.00股股份（占公司总股份的16.96%）与东方证券股份有限公司办理了股票质押式回购业务。本次股票质押登记手续已于2014年11月6日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理完毕，质押期限自2014年11月6日起至质权人办理解除质押登记手续之日止。

截止目前，弘高慧目公司持有本公司股份126,295,812.00股，占本公司总股份的30.60%，累计质押70,000,000.00股，占本公司总股本的16.96%。

特此公告

江苏东光微电子股份有限

董 事 会

二〇一四年十一月七日

---

股票代码:600455 股票简称:博通股份 公告编号:2014-047

# 西安博通资讯股份有限公司 关于重大资产重组延期复牌的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

西安博通资讯股份有限公司（简称“公司”或“本公司”）拟进行重大资产重组，经公司申请，公司股票自2014年9月2日起连续停牌30天，因重组工作量较大，经申请公司股票自10月8日起继续停牌30天，计划复牌日为不晚于11月10日（星期一）。该事项公司已于2014年9月2日、10月8日在《中国证券报》和上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）上披露公告。

公司本次重大资产重组交易标的拟为陕西汽车集团有限责任公司100%股权，主要交易对方拟为陕西汽车控股集团有限公司，交易方式拟为“资产置换+发行股份购买资产”。2014年9月22日陕西省国资委出具了《陕西省人民政府国有资产监督管理委员会关于陕西汽车集团有限责任公司重组上市工作的预审批复》（陕国资改革发[2014]188号），原则同意陕西汽车集团有限责任公司重组西安博通资讯股份有限公司实现借壳上市。

在公司股票停牌期间，本公司和相关各方一直在积极推进本次重组的各项工作，抓紧筹划、商议本次重大资产重组事项的具体方案和相关事宜，目前正在进行标的资产的相关审计、评估，并履行国资委审核等工作，同时，公司严格按照监管要求及时履行信息披露义务，每周披露一次该事项进展公告。截止本公告日，本次重大资产重组事项的相关工作仍在推进过程中。

由于本次重大资产重组涉及的资产规模较大，相关工作所需时间较长，公司预计难以在原定期限内完成相关工作并公司股票复牌交易，为推进本次重组，保护上市公司和广大投资者的利益以及保证信息披露内容的准确性，经公司向上海证券交易所申请延期复牌，公司股票自2014年11月10日起继续停牌30天，计划复牌日为不晚于2014年12月10日（星期三）。

本公司承诺本公司拟在2014年11月10日之后的30天内按照《上市公司重大资产重组管理办法》及其它相关规定，召开董事会审议重大资产重组预案，公司股票将于公司披露重大资产重组预案后恢复交易。在公司股票继续停牌期间，公司将按照相关规定及时履行信息披露义务，将每周公告一次该重大资产重组事项的进展情况。

《中国证券报》和上海证券交易所网站（http://www.sse.com.cn）是公司指定的信息披露报纸和网站，公司董事会提醒投资者注意有关公司信息以公司指定的信息披露报纸和网站为准，本次重大资产重组事项尚存在重大不确定性，敬请广大投资者理性投资，注意投资风险。

特此公告。

西安博通资讯股份有限公司董事会

2014年11月7日

---

证券代码:600571 证券简称:信雅达 编号:临2014-032

# 信雅达系统工程股份有限公司重大资产重组延期复牌公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

因信雅达系统工程股份有限公司（以下简称:公司、本公司）筹划发行股份购买资产的重大事项，公司于2014年09月09日发布了《关于重大资产重组的停牌公告》并申请股票连续停牌。2014年09月16日、09月23日、09月30日，公司分别披露了《重大资产重组停牌进展公告》。公司于2014年10月09日发布了《关于重大资产重组的延期复牌公告》并申请股票继续停牌。2014年10月16日、10