

交银施罗德保本混合型证券投资基金

2010 第一季度报告

2010年3月31日

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,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。

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

1.本期已实现收益 54,883,715.77
2.本期利润 63,090,708.34

3.加权平均基金份额本期利润 0.60
4.期末基金份额净值 3.277,435.61

5.期末基金资产净值 1,076
注:本基金本报告期未发生基金份额持有人认购及基金赎回业务,计入本期损益的认购及赎回手续费为零。

3.2 本基金净值增长率与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

过去三个月 1.96% 0.30% 0.81% 0.01% 1.15% 0.29%
本基金合同生效至今 9.61% 0.26% 4.02% 0.01% 5.59% 0.25%

3.3 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
交银施罗德保本混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2010年1月21日至2010年3月31日

注:本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月。截至2010年3月31日,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规定。

4.1 基金经理人
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

张海军 本基金的基金经理 2009-1-21 - 10年
张海军先生,中国国籍,经济学硕士,历任中国银河证券研究所市场策略部高级研究员,2009年1月加入交银施罗德基金管理有限公司,担任本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》及其他相关法律法规,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资组合符合有关法律法规和基金合同的约定,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易专项说明
4.3.2 公平交易专项说明
4.3.3 公平交易专项说明

4.4 管理人对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩表现的说明
4.4.2 报告期内本基金投资策略和业绩表现的说明

4.5 报告期内基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 828,838,472.14 22.95
其中:股票 828,838,472.14 22.95

2 固定收益投资 2,310,324,418.88 63.97
其中:债券 2,229,549,418.88 61.73
资产支持证券 80,775,000.00 2.24

3 金融衍生品投资 - -
4 买入返售金融资产 - -
其中:买入返售的买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 443,975,278.80 12.29
6 其他资产 28,608,573.54 0.79
7 合计 3,611,746,743.06 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林牧渔业 - -
B 采矿业 - -
C 制造业 327,149,602.22 9.53

CD 食品饮料 44,473,773.24 1.36
C1 纺织、服装、皮毛 1,108,299.00 0.03
C2 木材、家具 - -
C3 造纸、印刷 1,911,939.92 0.06

C4 石油、化学、塑胶、塑料 31,279,403.51 0.95
C5 电子 16,093,545.50 0.49
C6 金属、非金属 13,081,618.56 0.40

C7 机械、设备、仪表 177,249,327.67 5.41
C8 医药、生物制品 38,806,033.21 1.18
C9 其他制造业 3,145,644.99 0.10

D 电力、煤气及水的生产和供应业 19,299,122.19 0.59
E 建筑业 18,885,962.46 0.58
F 交通运输、仓储业 19,679,713.04 0.60

G 信息技术业 153,413,657.08 4.13
H 批发和零售贸易 73,746,100.00 2.23
I 金融、保险业 134,625,348.39 3.71

J 房地产业 5,734,919.71 0.17
K 社会服务业 4,670,400.00 0.14
L 传播与文化产业 - -
M 综合类 6,851,203.17 0.21

合计 828,838,472.14 25.29

5.3 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
序号 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 000858 广药 1,499,789 42,249,056.13 1.29
2 600511 国药股份 1,649,950 41,314,748.00 1.26

3 600879 航天电子 2,500,000 31,925,000.00 0.97
4 600031 三一重工 900,000 30,519,000.00 0.93

5 000001 深发展A 1,299,800 15,716,000.00 0.92
6 601090 中国铁建 4,485,000 18,165,800.00 0.86

7 600659 嘉农安 6,490,910 27,198,733.50 0.83
8 601998 中信银行 2,599,300 26,459,331.15 0.81

9 600853 航发工程 3,671,388 26,446,741.20 0.81
10 600276 恒瑞医药 599,933 23,523,372.93 0.72

5.4 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 国债期货 - -
2 央行票据 300,945,000.00 9.18

3 国债期货 618,404,100.00 18.87
其中:政策性金融债 618,404,100.00 18.87

4 企业债券 1,289,666,318.88 38.12
5 企业短期融资券 66,534,000.00 1.85

6 国债 - -
7 其他 - -
8 合计 2,229,549,418.88 68.02

5.5 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资产支持证券投资明细
序号 代码 资产名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 090218 09国债18 2,070,000 207,269,100.00 6.32
2 090117 08央行票据17 1,500,000 153,420,000.00 4.68

3 090138 09央行票据38 1,500,000 147,525,000.00 4.50
4 125012 08国债12 1,382,800 136,166,600.00 4.13

5 080221 08国债21 1,200,000 119,172,000.00 3.65

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 证券代码 证券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 083011 德信A 1,500,000 80,775,000.00 2.46

5.7 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权证投资明细
本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 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发生任何重大违法违规行为,本基金投资的前十名证券的发行主体未发生任何重大违法违规行为。

5.8.2 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.3 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.4 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.5 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.6 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.7 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.8 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.9 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.10 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.11 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.12 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.13 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.14 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.15 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.16 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.17 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.18 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.19 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.20 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.21 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.22 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.23 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.24 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.25 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.26 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.27 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.28 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.29 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.30 基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

交银施罗德成长股票证券投资基金

2010 第一季度报告

2010年3月31日

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,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。

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

1.本期已实现收益 164,446,970.08
2.本期利润 -632,340,235.87

3.加权平均基金份额本期利润 -0.1967
4.期末基金份额净值 7.689,595,987.52

5.期末基金资产净值 2,559

注:本基金本报告期未发生基金份额持有人认购及基金赎回业务,计入本期损益的认购及赎回手续费为零。

3.2 本基金净值增长率与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

过去三个月 -6.92% 1.12% -3.56% 1.00% -3.36% 0.12%

本基金合同生效至今 179.76% 1.90% 78.69% 1.79% 101.07% 0.11%

3.3 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
交银施罗德成长股票证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2010年10月23日至2010年3月31日

注:本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月。截至2010年3月31日,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规定。

4.1 基金经理人
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

曹伟峰先生,中国国籍,CFP,金融学硕士,历任中国银河证券研究所市场策略部高级研究员,2009年1月加入交银施罗德基金管理有限公司,担任本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》及其他相关法律法规,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资组合符合有关法律法规和基金合同的约定,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易专项说明
4.3.2 公平交易专项说明
4.3.3 公平交易专项说明

4.4 管理人对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩表现的说明
4.4.2 报告期内本基金投资策略和业绩表现的说明

4.5 报告期内基金资产组合情况
序号 项目 金额(人民币元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 366,531,667.09 92.88
其中:股票 313,302,486.13 79.42

2 固定收益投资 53,139,260.94 13.47
其中:债券 - -
资产支持证券 - -

3 买入返售金融资产 - -
其中:买入返售的买入返售金融资产 - -

4 银行存款和结算备付金合计 20,006,764.77 5.07
5 其他资产 8,073,428.48 2.05
6 合计 394,611,364.34 100.00

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

1 权益投资 366,531,667.09 92.88
其中:股票 313,302,486.13 79.42

2 固定收益投资 53,139,260.94 13.47
其中:债券 - -
资产支持证券 - -

3 买入返售金融资产 - -
其中:买入返售的买入返售金融资产 - -

4 银行存款和结算备付金合计 20,006,764.77 5.07
5 其他资产 8,073,428.48 2.05
6 合计 394,611,364.34 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
序号 行业类别 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

香港 163,092,102.53 42.42
美国 125,625,919.51 32.50

英国 16,351,642.90 4.23
日本 14,634,987.49 3.79

韩国 11,199,351.63 2.90
印度 5,403,263.92 1.40

荷兰 5,109,127.60 1.32
印度尼西亚 5,007,565.94 1.30

新加坡 3,611,795.33 0.93
中国 3,462,339.85 0.88

加拿大 2,774,475.53 0.72
台湾 2,174,377.50 0.57

其他 2,139,226.63 0.55
西班牙 2,239,426.63 0.57

合计 1,820,066.13 0.47

5.3 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
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

1 权益投资 366,531,667.09 92.88
其中:股票 313,302,486.13 79.42

2 固定收益投资 53,139,260.94 13.47
其中:债券 - -
资产支持证券 - -

3 买入返售金融资产 - -
其中:买入返售的买入返售金融资产 - -

4 银行存款和结算备付金合计 20,006,764.77 5.07
5 其他资产 8,073,428.48 2.05
6 合计 394,611,364.34 100.00

5.4 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 存单 4,786,686.91
2 应收证券清算款 223,856.31

3 应收利息 1,007.71
4 国债期货 311,872.14

5 其他 2,730,000.00

6 其他 - -
7 国债期货 - -
8 其他 - -
9 合计 4,807,428.87

5.5 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资产支持证券投资明细
本报告期末未持有资产支持证券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本报告期末未持有权证。

5.7 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权证投资明细
本报告期末未持有权证。

5.8 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
本报告期末未持有权证。

5.8.1 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
本报告期末未持有权证。

5.8.2 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
本报告期末未持有权证。

5.8.3 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权证投资明细
本报告期末未持有权证。

5.8.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本报告期末未持有权证。

5.8.5 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
本报告期末未持有权证。

5.8.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本报告期末未持有权证。

5.8.7 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权证投资明细
本报告期末未持有权证。

5.8.8 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
本报告期末未持有权证。

5.8.9 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
本报告期末未持有权证。

5.8.10 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
本报告期末未持有权证。

5.8.11 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
本报告期末未持有权证。

5.8.12 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
本报告期末未持有权证。

5.8.13 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
本报告期末未持有权证。

5.8.14 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
本报告期末未持有权证。

5.8.15 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
本报告期末未持有权证。

5.8.16 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
本报告期末未持有权证。

5.8.17 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
本报告期末未持有权证。

5.8.18 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
本报告期末未持有权证。

5.8.19 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
本报告期末未持有权证。

5.8.20 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
本报告期末未持有权证。

5.8.21 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
本报告期末未持有权证。

5.8.22 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
本报告期末未持有权证。

5.8.23 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
本报告期末未持有权证。

5.8.24 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
本报告期末未持有权证。

5.8.25 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
本报告期末未持有权证。

5.8.26 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
本报告期末未持有权证。

5.8.27 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
本报告期末未持有权证。

5.8.28 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
本报告期末未持有权证。

交银施罗德环球精选价值证券投资基金

2010 第一季度报告

2010年3月31日

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,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。

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

1.本期已实现收益 -2,242,294.12
2.本期利润 -15,876,252.17

3.加权平均基金份额本期利润 -0.064
4.期末基金份额净值 386,540,900.00

5.期末基金资产净值 1,510

注:本基金本报告期未发生基金份额持有人认购及基金赎回业务,计入本期损益的认购及赎回手续费为零。

3.2 本基金净值增长率与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