



上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金 2010 年年度报告摘要

2010年12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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年三月二十八日

§1 重要提示

1.1 重要提示
 基金管理人的董事会、董事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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
 本基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)根据《中国农业银行》于 2011 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,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及其更新。
 本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
 本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证 180 公司治理 ETF
基金代码	510100
交易代码	510100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,355,234,362 份
基金合同存续期	不定期
基金上市交易所	上海证券交易所
上市日期	2009 年 12 月 15 日

注:本表所列的基金代码 510100 为本基金二级市场交易代码,本基金一级市场申购赎回代码为 510101。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法,跟踪上证 180 公司治理指数,以完全复制标的指数成份股或其权重和权重成份股投资比例为原则,通过被动式指数投资,跟踪标的指数的表现,力求跟踪偏离度及跟踪误差最小化,力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年化跟踪误差不超过 0.5%。
业绩比较基准	上证 180 公司治理指数
风险收益特征	本基金跟踪标的指数,风险收益与标的指数基金、股票基金与货币型基金。本基金为指数型基金,跟踪标的指数,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中风险程度、收益预期较高的品种。

2.3 基金管理人和其他托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	交银施罗德基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
姓名	陈星	李青野
联系电话	021-61055500	010-66060089
电子邮箱	cs@yfrf.com.cn	ylq@abc.com.cn
客户服务热线	400-700-5000 021-61050000	95599
传真	021-61050344	010-63120116

2.4 信息披露方式

信息披露网站	www.fund.com.cn www.jsf.com.cn www.jsc.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年9月25日至2009年12月31日	金额单位:人民币元
本期利润总额	-387,463,941.45	8,527,206.47	
本期公允价值变动损益	-1,133,314,798.58	178,698,253.62	
加权平均基金份额本期利润	-0.1756	0.1406	
本期基金份额净值增长率	-18.07%	1.61%	
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	金额单位:人民币元
期末可供分配利润	-40,008,578,961.02	7,065,438,828.40	
期末可供分配基金份额	0.748	0.911	

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。
 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
 3.2 基金净值表现

3.2.1 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

期间	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	份额净值增长率-业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去三个月	4.91%	1.76%	4.44%	1.76%	0.47%
过去六个月	13.88%	1.53%	12.29%	1.52%	1.56%
过去一年	-18.07%	1.57%	-19.79%	1.58%	1.72%
自基金合同生效以来	-16.76%	1.52%	-8.36%	1.62%	-8.49%

3.2.2 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

项目	2010年12月31日	2009年12月31日	2009年9月25日
资产	4,176,702.47	3,176,702.47	84,255,265.98
负债	-	-	-
净资产	4,176,702.47	3,176,702.47	84,255,265.98
基金份额净值	0.748	0.911	1.406

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

年份	每 10 份基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率
2010	-18.07%	1.61%
2009	1.61%	1.61%

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金业绩情况

4.1.1 基金管理人及基金业绩情况

本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月4日成立的合资基金管理公司,公司总部设在上海,注册资本2亿元人民币。截止至2010年12月31日,公司已经发行并管理的基金共有十三只,均为开放式基金:交银施罗德精选证券投资基金(基金合同生效日:2005年9月29日),交银施罗德货币市场证券投资基金(基金合同生效日:2006年1月20日),交银施罗德稳健配置灵活证券投资基金(基金合同生效日:2006年6月14日),交银施罗德成长股票证券投资基金(基金合同生效日:2006年10月23日),交银施罗德蓝筹股票证券投资基金(基金合同生效日:2007年8月14日),交银施罗德增利债券证券投资基金(基金合同生效日:2008年3月31日),交银施罗德环保主题价值证券投资基金(基金合同生效日:2008年8月22日),交银施罗德保本混合型证券投资基金(基金合同生效日:2009年1月21日),交银施罗德先锋股票证券投资基金(基金合同生效日:2009年4月10日),上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金(基金合同生效日:2009年9月25日),交银施罗德上180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金(基金合同生效日:2009年9月29日),交银施罗德主题轮动灵活配置证券投资基金(基金合同生效日:2010年6月30日)和交银施罗德趋势优先股票证券投资基金(基金合同生效日:2010年12月22日)。

4.1.2 基金业绩(基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
陈星	基金经理	2009-9-25	14年	硕士研究生,数量金融硕士,历任交银施罗德基金基金经理,交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理,交银施罗德精选证券投资基金基金经理,交银施罗德成长股票证券投资基金基金经理,交银施罗德蓝筹股票证券投资基金基金经理。
何晓莺	基金经理	2009-9-25	6年	硕士研究生,经济学硕士,FRM,历任长城基金资产管理公司基金经理,交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理,交银施罗德精选证券投资基金基金经理。

注:1、本表所列基金基金经理任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告(如适用)之日为准。
 2、本表所列基金基金经理证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
 本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、安全合规的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有出现违法违规行为。
 本报告期内,本基金整体运作符合法律法规,无不当内幕交易和关联交易,基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定,未发生损害基金份额持有人利益的行为。
 4.3 管理人对报告期内基金交易情况的专项说明
 4.3.1 公平交易制度的执行情况
 本公司有严格的基金投资决策制度和风险控制制度来保证旗下基金运作的公平,报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率、投资类别、股票、债券、可转债收益率及不同时间段的买入、卖出、日内、10日内、期间交易的交易价格并未发现异常差异。
 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩表现出现差异超过 5%的情形。
 4.3.3 异常交易行为的专项说明
 本基金本报告期末未发现异常交易行为。
 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1 权益投资	4,008,538,791.30	99.90
2 固定收益投资	-	-
3 金融衍生品投资	-	-
4 买入返售金融资产	-	-
5 银行存款和结算备付金合计	3,810,411.40	0.09
6 其他各项资产	289,200.85	0.01
7 合计	4,012,638,413.55	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	占基金总资产的比例(%)
A	农林牧渔	420,334,248.08	10.49
C	制造业	866,250,711.07	21.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,416,462.55	0.51
E	建筑业	17,792,816.76	0.44
F	批发和零售业	23,040,641.08	0.57
G	房地产业	-	-
H	金融业	145,139,428.00	3.62
I	信息技术业	279,304,323.33	6.97
J	传播和文化产业	10,200,600.00	0.26
M	合计	4,012,638,413.55	100.00

5.3 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.4 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.5 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.6 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.7 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.8 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.9 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.10 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.11 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.12 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.13 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.14 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.15 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.16 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-
8 净资产	4,012,638,413.55	100.00

5.17 报告期末按公允价值层级划分的基金资产组合情况

项目	公允价值	占基金总资产的比例(%)
1 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,009,284,164.00	25.15
2 可供出售金融资产	-	-
3 持有至到期投资	-	-
4 应收款项	-	-
5 其他流动资产	-	-
6 其他资产	-	-
7 负债	-	-