

交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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
重要提示
基金管理人的责任、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...

2.1 基金基本情况
基金名称:交银施罗德上证180公司治理ETF联接基金
基金代码:519066
交易代码:519067

2.2 基金产品说明
投资策略:紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化
业绩比较基准:上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金收益率*95%+银行活期存款利率*5%

2.3 基金管理人及基金托管人
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

Table with 4 columns: 项目, 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构. Lists names of various service providers.

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 4 columns: 指标, 2010年, 2009年9月29日, 2009年9月29日. Shows financial performance metrics.

3.2 基金净值表现

Table with 5 columns: 期间, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, 跟踪误差, 跟踪偏离度. Shows performance trends.

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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, 跟踪误差, 跟踪偏离度. Compares performance over time.

4 基金管理人及基金托管人

Table with 5 columns: 项目, 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构. Lists names of various service providers.

5.1 基金投资组合情况

Table with 5 columns: 资产, 附注, 本期, 上期. Shows asset and liability breakdown.

5.2 基金持有的股票市值和公允价值

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例. Lists stock holdings.

5.3 基金持有的债券市值和公允价值

Table with 5 columns: 债券代码, 债券名称, 数量, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例. Lists bond holdings.

注:本报告日期为2009年9月29日至2010年12月31日.基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期间计算.

效的跟踪投资和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益.
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行为,基金投资范围、投资比例及投资组合符合相关法律法规和基金合同的规定,未发现损害基金份额持有人利益的行为.

4.1 基金经理
4.2 基金经理变更
4.3 基金经理变更原因
4.4 基金经理变更后的过渡期安排

4.5 投资组合分析
4.6 投资组合分析
4.7 投资组合分析

4.8 投资组合分析
4.9 投资组合分析

4.10 投资组合分析
4.11 投资组合分析

4.12 投资组合分析
4.13 投资组合分析

4.14 投资组合分析
4.15 投资组合分析

4.16 投资组合分析
4.17 投资组合分析

4.18 投资组合分析
4.19 投资组合分析

4.20 投资组合分析
4.21 投资组合分析

4.22 投资组合分析
4.23 投资组合分析

4.24 投资组合分析
4.25 投资组合分析

4.26 投资组合分析
4.27 投资组合分析

4.28 投资组合分析
4.29 投资组合分析

4.30 投资组合分析
4.31 投资组合分析

4.32 投资组合分析
4.33 投资组合分析

4.34 投资组合分析
4.35 投资组合分析

4.36 投资组合分析
4.37 投资组合分析

4.38 投资组合分析
4.39 投资组合分析

4.40 投资组合分析
4.41 投资组合分析

4.42 投资组合分析
4.43 投资组合分析

4.44 投资组合分析
4.45 投资组合分析

4.46 投资组合分析
4.47 投资组合分析

4.48 投资组合分析
4.49 投资组合分析

4.50 投资组合分析
4.51 投资组合分析

4.52 投资组合分析
4.53 投资组合分析

4.54 投资组合分析
4.55 投资组合分析

4.56 投资组合分析
4.57 投资组合分析

4.58 投资组合分析
4.59 投资组合分析

4.60 投资组合分析
4.61 投资组合分析

4.62 投资组合分析
4.63 投资组合分析

4.64 投资组合分析
4.65 投资组合分析

4.66 投资组合分析
4.67 投资组合分析

4.68 投资组合分析
4.69 投资组合分析

4.70 投资组合分析
4.71 投资组合分析

4.72 投资组合分析
4.73 投资组合分析

4.74 投资组合分析
4.75 投资组合分析

4.76 投资组合分析
4.77 投资组合分析

4.78 投资组合分析
4.79 投资组合分析

4.80 投资组合分析
4.81 投资组合分析

4.82 投资组合分析
4.83 投资组合分析

报告附注为财务报表的组成部分.
本报告附注与报表正文具有同等法律效力,无不当内幕交易和关联交易行为.

7.1 基金基本情况
7.2 基金投资组合
7.3 基金投资组合

7.4 基金投资组合
7.5 基金投资组合

7.6 基金投资组合
7.7 基金投资组合

7.8 基金投资组合
7.9 基金投资组合

7.10 基金投资组合
7.11 基金投资组合

7.12 基金投资组合
7.13 基金投资组合

7.14 基金投资组合
7.15 基金投资组合

7.16 基金投资组合
7.17 基金投资组合

7.18 基金投资组合
7.19 基金投资组合

7.20 基金投资组合
7.21 基金投资组合

7.22 基金投资组合
7.23 基金投资组合

7.24 基金投资组合
7.25 基金投资组合

7.26 基金投资组合
7.27 基金投资组合

7.28 基金投资组合
7.29 基金投资组合

7.30 基金投资组合
7.31 基金投资组合

7.32 基金投资组合
7.33 基金投资组合

7.34 基金投资组合
7.35 基金投资组合

7.36 基金投资组合
7.37 基金投资组合

7.38 基金投资组合
7.39 基金投资组合

7.40 基金投资组合
7.41 基金投资组合

7.42 基金投资组合
7.43 基金投资组合

7.44 基金投资组合
7.45 基金投资组合

7.46 基金投资组合
7.47 基金投资组合

7.48 基金投资组合
7.49 基金投资组合

7.50 基金投资组合
7.51 基金投资组合

7.52 基金投资组合
7.53 基金投资组合

7.54 基金投资组合
7.55 基金投资组合

7.56 基金投资组合
7.57 基金投资组合

7.58 基金投资组合
7.59 基金投资组合

7.60 基金投资组合
7.61 基金投资组合

7.62 基金投资组合
7.63 基金投资组合

7.64 基金投资组合
7.65 基金投资组合

7.66 基金投资组合
7.67 基金投资组合

7.68 基金投资组合
7.69 基金投资组合

7.70 基金投资组合
7.71 基金投资组合

7.72 基金投资组合
7.73 基金投资组合

7.74 基金投资组合
7.75 基金投资组合

7.76 基金投资组合
7.77 基金投资组合

7.78 基金投资组合
7.79 基金投资组合

7.80 基金投资组合
7.81 基金投资组合

7.82 基金投资组合
7.83 基金投资组合

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读载于基金管理人网站的年度报告正文.

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动
8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例. Lists stock purchases.

注:本期累计买入金额"买入"成交金额"成交"成交金额"成交"成交金额"成交"成交金额"成交"成交金额"成交"成交金额

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例. Lists stock sales.

注:本期累计卖出金额"卖出"成交金额"成交"成交金额"成交"成交金额"成交"成交金额"成交"成交金额"成交"成交金额

8.6 期末按市值占基金净资产比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金净资产比例. Lists top 10 stocks.

买入股票的成本(或交易费用) 卖出股票的公允价值(或交易费用)

8.7 期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金净资产比例. Lists top 5 bonds.

8.8 期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金净资产比例. Lists top 10 ASIs.

8.9 期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名权证投资明细

8.10 投资组合报告附注
8.10.1 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,在本报告编制前一年

8.10.2 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.

8.10.3 期末其他各项资产构成

Table with 5 columns: 序号, 资产名称, 金额. Lists other assets.

8.11 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

8.12 报告期末本基金持有的公允价值低于成本的交易品种明细

8.13 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易品种明细

8.14 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易品种明细

8.15 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易品种明细

8.16 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易品种明细

8.17 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易品种明细

8.18 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易品种明细

8.19 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易品种明细

8.20 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易品种明细

8.21 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易品种明细