交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）根据本基金合同规定，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6月30日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银主题优选混合	
基金主代码	519700	
交易代码	519700(前端)	519701(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年6月30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	
报告期末基金份额总额	1,144,468,160.70份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力图通过前瞻性的主题优选，积极把握行业和个股投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济发展趋势、经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整投资组合比例，自上而下灵活配置资产；通过优选主题配置和挖掘预期具有良好增长前景的优势行业相结合的方式，精选个股，以谋求超额收益。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率
风险收益特征	本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

2.3 基金管理人和基金托管人

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈超	尹东
	联系电话	021-61055050	010-67595003
	电子邮箱	xxpl@jysld.com， disclosure@jysld.com	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-700-5000，021-61055000	010-67595096
传真		021-61055034	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

§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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010年6月30日(基金合同生效日)至2010年12月31日
本期已实现收益	165,917,644.53
本期利润	235,463,601.14
加权平均基金份额本期利润	0.1177
本期基金份额净值增长率	12.60%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末
期末可供分配基金份额利润	0.126
期末基金资产净值	1,288,554,699.66
期末基金份额净值	1.126

注：1、本基金基金合同生效日为2010年6月30日，基金合同生效日至本报告期期末，本基金运作时间未满一年；

2、本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；

3、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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	7.44%	1.45%	3.38%	1.07%	4.06%	0.38%
过去六个月	12.60%	1.08%	12.68%	0.94%	-0.08%	0.14%
自基金合同生效起至今	12.60%	1.07%	11.97%	0.94%	0.63%	0.13%

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

注：本基金基金合同生效日为2010年6月30日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2010年12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约定。

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

注：图示日期为2010年6月30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计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金的基金管理人为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。公司总部设于上海，注册资本为2亿元人民币。截止到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：交银施罗德精选股票证券投资基金（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混合型证券投资基金（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8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）、交银施罗德环球精选价值证券投资基金（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）、交银施罗德上证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）、交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金（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 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
史伟	本基金的基金经理、交银施罗德先锋股票证券投资基金基金经理	2010-06-30	-	9年	史伟先生，英国雷丁大学经济学硕士。历任东方证券证券投资部行业研究员，华宝兴业基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理。2008年加入交银施罗德基金管理有限公司。

注：1、本表所列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、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效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，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，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，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司有严格的投资控制制度和风险监控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、分投资类别（股票、债券）的收益率以及不同时间窗内（同日内、5日内、10日内）同向交易的交易价格未发现异常差异。

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比较

本投资组合运作未满一年，其2010年度收益率与其他中高风险投资组合年度收益不具有可比性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内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

本基金于2010年6月底成立，截至到年底基金份额净值为1.126元。

回顾2010年本基金的运作，3季度中国股市整体表现活跃，沪深300指数上涨了14.5%，3季度本基金处于刚刚成立后的建仓期，本基金采取了非常稳健、逐步建仓的策略，尤其是在7月中上旬时，在市场波动较大、且宏观政策不甚明朗的情况下，建仓速度较慢，而到7月22日中央会议明确了“保增长”成为了中央对经济工作的主基调后，本基金适度提高了建仓速度，逐步分享了股市活跃的成果，但是建仓初期基金份额净值的表现仍低于比较基准。

本基金管理人在判断宏观政策出现略微“修正”后，采取了稳定增长和部分周期类股票相结合的建仓方式，在8、9月份取得了一定效果。然而9月末到来的流动性推升的资源、资产类股票没有得到足够的重视，未能较好分享此类股票相关的超额收益。

4季度的行情略显跌宕起伏，10月份以有色、煤炭为代表的周期股强势上涨，导致资产市场预期大小盘切换行情，众多小股票出现明显回调。本基金也是认同全球货币战争这一逻辑，同时认同流动性驱动行情的判断，适度增仓了商品类股票。但是由于没有足够重视悄然上升的通胀数据，以及管理层对于通胀上升带来的担心与政策措施，在11月份的回调中仓位调整力度不足，对净值有所影响。12月份本基金依靠基本持仓和精选股票，挽回了部分11月份的损失。

从2010年4季度开始高企的通货膨胀，导致了国家政策的紧缩格局，央行已经连续上调利率与准备金率。同时我们观察到，截至2011年1月份，货币与信贷数据的环比折年率已经处于较低的位置，根据历史经验，经济增长数据与通胀数据在未来几个月内将出现下滑。那么在这种政策环境，和经济及通胀前景预期下，股票市场出现趋势性上涨的难度较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年12月31日，本基金份额净值为1.126元，本报告期份额净值增长率为12.60%，同期业绩比较基准增长率为11.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

但是春节过后，我们注意到股票市场在加息与加准备金率的压力下，并没有出现恐慌性下跌，原因在于股票市场的估值已经接近于历史底部区域，基本反映较为悲观的经济前景预期。综合上述判断，本基金认为股票市场在通胀回落前，呈现区间波动的概率较大。

然而本基金并不认同目前主流观点，即判断全年都呈现区间波动，缺乏投资机会，而是认为至少目前看下半年的股票市场还是可能存在一定的上行空间的。根据历史经验，虽然在紧缩政策环境下，经济增长与通胀可能将在年中回落，但届时国家政策也将出现明显变化，从紧缩到走平甚至扩张，那么股票市场将因此有望获得良好的投资机会与投资窗口。所以本基金认为，对于全年操作策略而言，未必需要全年防御，在通胀回落时要做好从防御走向进攻的准备。

本基金将按照基金合同与各项法律法规的要求，注重关注主题投资机会，结合公司内部研究成果，争取为持有人获得更佳的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，由金融工程部进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照法律法规及基金合同的约定，本报告期内本基金利润分配信息列示如下：

金额单位：人民币元

本报告期内应分配金额	本报告期内已分配金额	尚未分配利润金额	本报告期内分红次数
14,408,653.90	-	14,408,653.90	-

本基金于2011年1月12日进行本报告期利润的第一次分红，向基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.15元。本次分红的权益登记日、除息日为2011年1月12日，红利再投确认日为2011年1月13日，现金红利划出日为2011年1月14日。本基金此次分配金额为16,611,722.45元，此次分红之后，2010年度本基金分红次数和分配比例达到了法律法规及基金合同的要求。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司对交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金2010年12月31日的资产负债表，2010年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告（普华永道中天审字（2011）第20370号）。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	175,520,204.44
结算备付金		2,994,989.71
存出保证金		325,356.06
交易性金融资产	7.4.7.2	1,108,761,766.11
其中：股票投资		889,881,766.11
基金投资		-
债券投资		218,880,000.00
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	100,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	4,557,649.84
应收股利		-
应收申购款		1,767,933.64
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,393,927,899.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		100,000,932.15
应付赎回款		1,429,581.47
应付管理人报酬		1,676,677.65
应付托管费		279,446.29
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	1,625,871.20
应交税费		68,500.00
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	292,191.38
负债合计		105,373,200.14
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	1,144,468,160.70
未分配利润	7.4.7.10	144,086,538.96
所有者权益合计		1,288,554,699.66
负债和所有者权益总计		1,393,927,899.80

注：1、报告截止日2010年12月31日，基金份额净值1.126元，基金份额总额1,144,468,160.70份。

2、本财务报表的实际编制期间为2010年6月30日（基金合同生效日）至2010年12月31日。

3、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体：交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2010年6月30日（基金合同生效日）至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年6月30日(基金合同生效日)至2010年12月31日
一、收入		260,206,586.95
1.利息收入		8,580,851.88
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,128,530.75
债券利息收入		4,067,650.44
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,384,670.69
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		179,066,446.13
其中：股票投资收益	7.4.7.12	179,557,481.01
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-546,690.88
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	55,656.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	69,545,956.61
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	3,013,332.33
减：二、费用		24,742,985.81
1.管理人报酬		15,669,527.38
2.托管费		2,611,587.91
3.销售服务费		-
4.交易费用	7.4.7.18	6,158,229.31
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	7.4.7.19	303,641.21
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		235,463,601.14
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列		235,463,601.14

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2010年6月30日（基金合同生效日）至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年6月30日(基金合同生效日)至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,235,642,950.36	-	3,235,642,950.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	235,463,601.14	235,463,601.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,091,174,789.66	-91,377,062.18	-2,182,551,851.84
其中：1.基金申购款	212,653,005.20	15,422,489.13	228,075,494.33
2.基金赎回款	-2,303,827,794.86	-106,799,551.31	-2,410,627,346.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,144,468,160.70	144,086,538.96	1,288,554,699.66

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：战龙，主管会计工作负责人：许珊燕，会计机构负责人：张丽

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2010]第624号《关于核准交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,234,778,164.71元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2010）第166号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2010年6月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,235,642,950.36份基金份额，其中认购资金利息折合864,785.65份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为30%-80%，债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的20%-70%，其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于2011年3月24日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010年6月30日（基金合同生效日）至2010年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2010年12月31日的财务状况以及2010年6月30日（基金合同生效日）至2010年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2010年6月30日（基金合同生效日）至2010年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

（2）存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

（3）当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分（包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等）为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分后的余额）。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

（2）基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

（4）基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司（“交银施罗德基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东、基金代销机构
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年6月30日(基金合同生效日)至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,669,527.38
其中：支付销售机构的客户维护费	3,573,646.22

注：支付基金管理人交银施罗德基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年6月30日(基金合同生效日)至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,611,587.91

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本报告期内本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2010年6月30日(基金合同生效日)至2010年12月31日
基金合同生效日(2010年6月30日)持有的基金份额	200,078,500.00
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	200,078,500.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.48%

注：基金管理人交银施罗德基金公司在本会计期间认购本基金的交易委托交通银行办理，适用招募说明书中规定的认购费率，认购费为2,000.00元。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年6月30日(基金合同生效日)至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	175,520,204.44	3,052,507.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金未发生其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601118	海南橡胶	2010-12-30	2011-04-07	网下中签	5.99	5.99	246,309	1,475,390.91	1,475,390.91	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

于本报告期末，本基金无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

（b）以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

于2010年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为889,881,766.11元，第二层级的余额为218,880,000.00元，无属于第三层级的余额。本基金本期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级。

（2）除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	889,881,766.11	63.84
	其中：股票	889,881,766.11	63.84
2	固定收益投资	218,880,000.00	15.70
	其中：债券	218,880,000.00	15.70
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	100,000,000.00	7.17
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	178,515,194.15	12.81
6	其他各项资产	6,650,939.54	0.48
7	合计	1,393,927,899.80	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,475,390.91	0.11
B	采掘业	39,126,176.92	3.04
C	制造业	627,926,741.80	48.73
C0	食品、饮料	102,515,048.16	7.96
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	8,634,291.91	0.67
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	70,436,182.51	5.47
C5	电子	17,330,903.58	1.34
C6	金属、非金属	87,426,282.68	6.78
C7	机械、设备、仪表	239,951,831.19	18.62
C8	医药、生物制品	101,632,201.77	7.89
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,466,890.00	0.11
E	建筑业	40,300,917.20	3.13
F	交通运输、仓储业	64,152,590.04	4.98
G	信息技术业	46,091,803.54	3.58
H	批发和零售贸易	67,228,934.70	5.22
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	2,112,321.00	0.16
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	889,881,766.11	69.06

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002266	浙富股份	1,672,068	78,587,196.00	6.10
2	600125	铁龙物流	4,448,862	64,152,590.04	4.98
3	000568	泸州老窖	1,223,439	50,038,655.10	3.88
4	600690	青岛海尔	1,546,367	43,623,013.07	3.39
5	600496	精工钢构	2,457,373	40,300,917.20	3.13
6	002024	苏宁电器	2,813,259	36,853,692.90	2.86
7	600062	双鹤药业	1,250,674	35,631,702.26	2.77
8	000418	小天鹅A	1,499,844	29,621,919.00	2.30
9	600600	青岛啤酒	807,043	27,988,251.24	2.17
10	600761	安徽合力	1,534,709	27,455,944.01	2.13

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	111,202,172.00	8.63
2	601166	兴业银行	82,832,936.26	6.43
3	601766	中国南车	75,950,608.88	5.89
4	600585	海螺水泥	70,478,130.66	5.47
5	600519	贵州茅台	69,189,527.26	5.37
6	600125	铁龙物流	63,450,398.84	4.92
7	002266	浙富股份	61,077,057.00	4.74
8	000568	泸州老窖	56,233,149.05	4.36
9	601668	中国建筑	54,411,971.00	4.22
10	002415	海康威视	53,664,476.09	4.16
11	000422	湖北宜化	53,408,400.46	4.14
12	000792	盐湖钾肥	53,334,535.28	4.14
13	600496	精工钢构	48,760,633.48	3.78
14	002065	东华软件	47,319,932.23	3.67
15	000680	山推股份	46,685,957.17	3.62
16	000877	天山股份	45,635,946.28	3.54
17	600720	祁连山	45,578,192.80	3.54
18	002032	苏泊尔	45,056,229.41	3.50
19	600066	宇通客车	41,874,455.16	3.25
20	002024	苏宁电器	39,940,122.78	3.10
21	600690	青岛海尔	39,722,622.44	3.08
22	002080	中材科技	39,423,672.46	3.06
23	600761	安徽合力	37,508,363.12	2.91
24	002155	辰州矿业	37,441,831.17	2.91
25	600887	伊利股份	37,315,838.06	2.90
26	600858	银座股份	35,194,659.17	2.73
27	600062	双鹤药业	34,814,961.74	2.70
28	000578	盐湖集团	34,371,628.60	2.67
29	601899	紫金矿业	32,851,605.50	2.55
30	600570	恒生电子	32,282,760.14	2.51
31	002123	荣信股份	32,059,984.88	2.49
32	300047	天源迪科	32,004,399.18	2.48
33	600600	青岛啤酒	31,378,045.03	2.44
34	000418	小天鹅A	30,795,695.73	2.39
35	000564	西安民生	28,992,456.70	2.25
36	002336	人人乐	28,340,057.55	2.20
37	000528	柳工	28,124,525.82	2.18
38	600216	浙江医药	27,869,742.76	2.16
39	000527	美的电器	26,362,407.20	2.05
40	600383	金地集团	26,248,566.00	2.04

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	108,820,768.00	8.45
2	601766	中国南车	102,864,348.74	7.98
3	600585	海螺水泥	71,802,385.28	5.57
4	601166	兴业银行	71,159,661.11	5.52
5	000422	湖北宜化	67,567,228.79	5.24
6	000792	盐湖钾肥	64,733,293.29	5.02
7	002415	海康威视	60,982,397.91	4.73
8	600519	贵州茅台	58,261,674.91	4.52
9	000877	天山股份	57,281,380.39	4.45
10	002065	东华软件	56,609,775.64	4.39
11	600720	祁连山	54,533,238.80	4.23
12	601668	中国建筑	53,881,250.00	4.18
13	002032	苏泊尔	52,818,848.53	4.10
14	000680	山推股份	47,891,879.18	3.72
15	600887	伊利股份	40,128,289.15	3.11
16	600858	银座股份	33,015,011.36	2.56
17	300047	天源迪科	32,193,176.67	2.50
18	600570	恒生电子	31,813,686.49	2.47
19	600216	浙江医药	31,207,030.79	2.42
20	000527	美的电器	31,093,559.67	2.41
21	601899	紫金矿业	30,075,392.23	2.33
22	000528	柳工	28,343,344.32	2.20
23	002001	新和成	27,874,422.49	2.16
24	000564	西安民生	27,581,464.23	2.14
25	600496	精工钢构	26,588,908.67	2.06

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本(成交)总额	2,441,979,043.58
卖出股票的收入(成交)总额	1,804,798,126.05

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	100,360,000.00	7.79
3	金融债券	49,135,000.00	3.81
	其中：政策性金融债	49,135,000.00	3.81
4	企业债券	19,450,000.00	1.51
5	企业短期融资券	49,935,000.00	3.88
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	218,880,000.00	16.99

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	0801044	08央行票据44	1,000,000	100,360,000.00	7.79
2	1081223	10农六师CP01	500,000	49,935,000.00	3.88
3	060225	06国开25	500,000	49,135,000.00	3.81
4	1080077	10马建投债	200,000	19,450,000.00	1.51

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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公开谴责和处罚。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	325,356.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,557,649.84
5	应收申购款	1,767,933.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,650,939.54

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.9.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
22,288	51,349.07	284,353,829.55	24.85%	860,114,331.15	75.15%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	455,872.10	0.04%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	3,235,642,950.36
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	212,653,005.20
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,303,827,794.86
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,144,468,160.70

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：2010年9月29日本基金管理人发布公告，经交银施罗德基金管理有限公司第二届董事会第二十次会议审议通过，同意莫泰山先生辞去公司总经理职务，并决定由公司副董事长雷贤达先生代为履行公司总经理职务。2011年1月26日本基金管理人发布公告，经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过，任命战龙先生担任本公司总经理。

2、本基金托管人基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人2011年2月9日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可[2011]115号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。本基金托管人2011年1月31日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所。报告年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的审计费90,000元，该审计机构首次为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券股份有限公司	1	775,194,251.74	18.27%	658,911.60	18.68%	-
中信建投证券有限责任公司	2	572,496,618.52	13.49%	465,156.06	13.19%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	560,479,807.35	13.21%	476,404.44	13.51%	-
长城证券有限责任公司	1	543,717,029.13	12.82%	441,773.57	12.52%	-
齐鲁证券有限公司	1	430,051,585.85	10.14%	349,419.30	9.91%	-
招商证券股份有限公司	1	415,438,217.81	9.79%	337,544.88	9.57%	-
北京高华证券有限责任公司	1	318,160,730.10	7.50%	270,437.47	7.67%	-
东方证券股份有限公司	2	222,678,099.73	5.25%	183,938.61	5.21%	-
中信证券股份有限公司	1	215,900,920.91	5.09%	183,515.55	5.20%	-
申银万国证券股份有限公司	1	74,566,652.57	1.76%	63,381.51	1.80%	-
中国银河证券股份有限公司	1	72,781,908.90	1.72%	61,864.25	1.75%	-
华融证券股份有限公司	1	41,127,596.11	0.97%	34,958.11	0.99%	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	5,318,673.97	25.79%	4,000,000,000.00	37.01%	-	-
齐鲁证券有限公司	938,505.86	4.55%	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	6,708,900,000.00	62.07%	-	-
东方证券股份有限公司	9,207,167.00	44.64%	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	5,161,897.80	25.03%	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	100,000,000.00	0.93%	-	-

注：1、报告期内，本基金的18个专用交易席位均为新增加席位；

2、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况和经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金专用交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

2010年1月29日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010年5月13日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010年6月21日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

2010年7月1日，托管人中国建设银行股份有限公司发布2009年度A股分红派息实施公告，每10股派发现金股息人民币2.02元（含税）。

2010年9月15日，托管人中国建设银行股份有限公司发布公告，张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长，谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

2010年11月2日，托管人中国建设银行股份有限公司发布2010年度A股配股发行公告。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一一年三月二十八日