交银施罗德信用添利债券证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011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:二〇一二年三月三十日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)根据本基金合同规定,于2012年3月28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2011年1月27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	交银信用添利债券
基金主代码	164902
交易代码	164902
基金运作方式	契约型,本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内,采取封闭式运作(按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外),在深圳证券交易所上市交易,封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2011年1月27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	1,895,085,749.23份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年4月20日

注:本基金场内简称为“交银添利”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势,自上而下进行宏观分析,自下而上精选个券,在控制信用风险、利率风险和流动性风险前提下,力求通过主动承担适度信用风险获得持续投资收益,谋求基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,动态调整大类金融资产比例,自上而下决定债券组合久期及债券类属配置;在严谨深入的信用分析基础上,综合考量信用债券的信用评级,以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选个券。同时,本基金也会关注股票一级市场、权证一级市场等其它相关市场存在的投资机会,力争实现基金总体风险收益特征保持不变前提下的基金资产增值最大化。
业绩比较基准	80%×中债企业债总全价指数收益率+20%×中债国债总全价指数收益率
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈超	李芳菲
	联系电话	021-61055050	010-63201510
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	95599
传真		021-61055054	010-63201816

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	2011年1月27日(基金合同生效日)至2011年12月31日
本期已实现收益	56,295,237.38
本期利润	-48,020,542.45
加权平均基金份额本期利润	-0.0253
本期基金份额净值增长率	-2.50%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.025
期末基金资产净值	1,847,065,206.78
期末基金份额净值	0.975

注:1、本基金基金合同生效日为2011年1月27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;

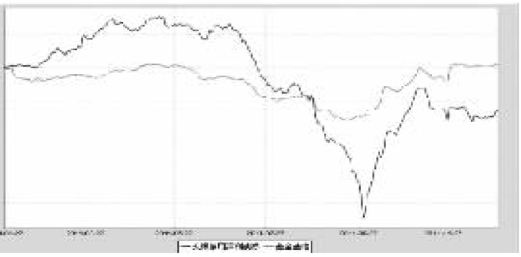
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

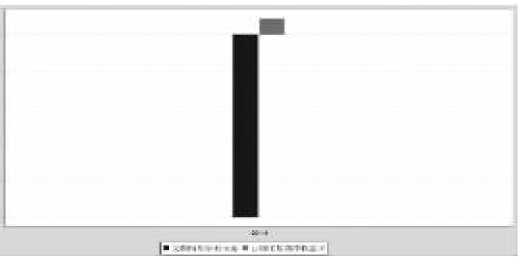
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.44%	0.32%	3.11%	0.16%	3.33%	0.16%
过去六个月	-4.79%	0.34%	0.76%	0.14%	-5.55%	0.20%
自基金合同生效起至今	-2.50%	0.28%	0.21%	0.11%	-2.71%	0.17%

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2011年1月27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。截至建仓期结束及本报告期末,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2011年1月27日至2011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
2011年	-	-	-	-	-
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2011年12月31日,公司已经发行并管理的基金共有十八只: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)、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)、交银施罗德信用添利债券证券投资基金(基金合同生效日:2011年1月27日)、交银施罗德先进制造股票证券投资基金(基金合同生效日:2011年6月22日)、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金(基金合同生效日:2011年9月22日)、交银施罗德双利债券证券投资基金(基金合同生效日:2011年9月26日)和交银施罗德深证300价值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:2011年9月28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		
林洪钧	本基金的基金经理、交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理	2011-01-27	-	7年	林洪钧先生,复旦大学学士。历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理,华安基金管理有限公司债券交易员,加拿大Financial Engineering Source Inc.金融研究员。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任专户投资部投资经理助理、专户投资经理。

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。本投资组合运作不满一年,因此其业绩表现与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率不具有可比性。不同时间窗内(同日内、5日内、10日内)同向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比较

本投资组合运作未满一年,其2011年度业绩表现与其他投资风格相似的投资组合业绩表现不具有可比性。

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

回顾2011年,信用债券市场经历了严峻的挑战。三季度发生的对城投债风险的担忧使得信用债市场流动性出现了大幅衰竭,信用债的估值也受到了极大压制,部分债券甚至一度出现12%以上的收益率。四季度投资者对信用风险不理性的担忧逐渐消退,市场重回合理谨慎轨道,但受制经济下行,企业盈利、现金流的恶化,低等级信用产品的信用利差仍不断创出新高。

在年末2个月,基本面发生了比较明确的变化。经济与通胀的双下行,使得利率产品、高等级的信用债的机会更加确定。大类资产配置的理念在四季度对组合的影响尤为显著。基本面的支持,加之信贷受制,债券市场乐观情绪在年末开始蔓延,各机构的杠杆运用都达到比较高的水平。

回顾全年,本基金净值下跌2.50%,组合在四季度较大幅度增持了长久期的利率产品和高等级信用产品,高等级信用产品给组合提供了较好的流动性,交易能力有较显著的提升。除了对纯债的增持,本基金在四季度对转债保持较为中性的观点,并不过度悲观,在转债市场经历了债底回升的估值修复后,后期的走势取决于权益类市场的表现,组合保持中性配置以待市场出现变化,力争获取更多的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年12月31日,本基金份额净值为0.975元,本报告期份额净值增长率为-2.50%,同期业绩比较基准增长率为0.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年底债券市场利率产品及高等级信用债券的上涨让投资者对2012年的债券市场充满了期待。经济下滑、通胀回落、货币政策的放松给债券市场注入了无限的想象力,然而债券市场行情演绎之快也令投资者感到棘手,展望2012年债券市场,我们理应在充满期待的同时保持一份谨慎。我们认为,2012年一季度,高等级信用产品的涨幅预计仍相对比较确定,债市在一季度出现牛市的概率较高。相对忽略个券配置,大类资产配置对组合的影响可能会更为显著。

而从信用风险层面分析,由于流动性状况在一季度仍将处于缓慢改善的过程中,流动性的释放对固定收益和权益市场都将是一个渐进的过程。随着流动性的释放,市场存在从高评级逐渐向低评级演绎的可能,但一如权益市场,在经济结构和产业政策的调整中寻找增长点,债券市场的走势可能将摈弃以往评级定收益的模式,对外部信用评级做更细致的区分,对不同行业的企业区别对待,在AA评级的信用债中寻找在经济复苏及转型过程中确定受益的品种可能将是未来信用债超额收益的来源。对后期行情的演绎我们保持谨慎乐观的态度,争取为持有人获取更稳健的收益。

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,由量化投资部进行测算和认证,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

本基金本报告期内未进行利润分配。

§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

在托管交银施罗德信用添利债券证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金合同》、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金托管协议》的约定,对交银施罗德信用添利债券证券投资基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司2011年1月27日(基金合同生效日)至2011年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德信用添利债券证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的交银施罗德信用添利债券证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部
2012年3月28日

§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信用添利债券证券投资基金2011年12月31日的资产负债表,2011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(2012)第20290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:交银施罗德信用添利债券证券投资基金

报告截止日:2011年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	7.4.7.1	1,318,441.63
结算备付金		62,076,697.44
存出保证金		7,412.01
交易性金融资产	7.4.7.2	3,098,425,484.37
其中:股票投资		56,295,467.99
基金投资		-
债券投资		3,042,130,016.38
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	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	79,124,308.52
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		3,240,952,343.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011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		1,388,347,194.87
应付证券清算款		118,728.04
应付赎回款		-
应付管理人报酬		939,840.13
应付托管费		313,280.04
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	38,121.98
应交税费		3,149,960.00
应付利息		614,512.13
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	365,500.00
负债合计		1,393,887,137.19
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	1,895,085,749.23
未分配利润	7.4.7.10	-48,020,542.45
所有者权益合计		1,847,065,206.78
负债和所有者权益总计		3,240,952,343.97

注:1、报告截止日2011年12月31日,基金份额净值0.975元,基金份额总额1,895,085,749.23份;

2、本财务报表的实际编制期间为2011年1月27日(基金合同生效日)至2011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:交银施罗德信用添利债券证券投资基金

本报告期:2011年1月27日(基金合同生效日)至2011年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月27日(基金合同生效日)至2011年12月31日
一、收入		-10,519,888.14
1.利息收入		112,488,777.61
其中:存款利息收入	7.4.7.11	980,951.25
债券利息收入		107,013,274.75
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,494,551.61
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-18,702,970.63
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-3,714,836.34
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-16,878,134.29
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	1,890,000.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-104,315,779.83
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	10,084.71
减:二、费用		37,500,654.31
1.管理人报酬		10,454,483.51
2.托管费		3,484,827.82
3.销售服务费		-
4.交易费用	7.4.7.19	77,074.95
5.利息支出		23,005,347.30
其中:卖出回购金融资产支出		23,005,347.30
6.其他费用	7.4.7.20	478,920.73
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-48,020,542.45
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-48,020,542.45

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德信用添利债券证券投资基金

本报告期:2011年1月27日(基金合同生效日)至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月27日(基金合同生效日)至2011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)	1,895,085,749.23	-	1,895,085,749.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-48,020,542.45	-48,020,542.45
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	1,895,085,749.23	-48,020,542.45	1,847,065,206.78

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

交银施罗德信用添利债券证券投资基金(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1601号《关于核准交银施罗德信用添利债券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《交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金,本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内,采取封闭式运作(按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外),在深圳证券交易所上市交易,封闭期满后转为上市开放式基金(LOF)。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集资本人民币1,894,760,542.88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(2011)第13号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金合同》于2011年1月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,895,085,749.23份,其中认购资金利息折合325,206.35份。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2011]第117号文审核同意,本基金份额211,820,433.00份于2011年4月20日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德信用添利债券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,主要投资于固定收益类资产,包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券及可分离转债、资产支持证券、次级债和债券回购等金融工具。本基金可同时投资于股票、权证等权益类产品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。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类金融工具,但可以参与一级市场股票首次公开发行或新股增发,并可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于分离交易可转债而产生的权证。本基金在封闭期内,对债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中对信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的80%;对股票、权证等非固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的20%。本基金的业绩比较基准为:80%×中债企业债总全价指数收益率+20%×中债国债总全价指数收益率。

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2012年3月20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》、《交银施罗德信用添利债券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2011年1月27日(基金合同生效日)至2011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2011年12月31日的财务状况以及2011年1月27日(基金合同生效日)至2011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2011年1月27日(基金合同生效日)至2011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。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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

封闭期内实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.000元。

7.4.4.8 损益平准金

封闭期内不适用。

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或者发行价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则按直线法计算。

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。本基金在封闭期内收益以现金形式分配。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

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须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[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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 2011年1月27日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,454,483.51
其中:支付销售机构的客户维护费	1,214,135.53

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0.6%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×0.6%÷当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月27日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,484,827.82

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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×0.2%÷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

本报告期内本基金未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

关联方名称	本期 2011年1月27日(基金合同生效日)至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	1,318,441.63	480,939.81

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,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(2011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
601100	恒立油缸	2011-10-21	2012-01-30	新股网下申购	23.00	16.71	471,028	10,833,644.00	7,870,877.88	-
601336	新华保险	2011-12-09	2012-03-16	新股网下申购	23.25	27.87	69,953	1,626,407.25	1,949,590.11	-
7.4.9.1.2 受限证券类别:债券										
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
122115	11华锐01	2011-12-29	2012-01-18	新债申购	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00	-

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

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2011年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额704,347,223.47元,是以如下债券作为抵押:

金融单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1180164	11铁道08	2012-01-11	101.49	900,000	91,341,000.00
1180014	11新乡投资债	2012-01-05	97.61	750,000	73,207,500.00
110218	11国开18	2012-01-11	101.31	700,000	70,917,000.00
1180164	11铁道08	2012-01-06	101.49	600,000	60,894,000.00
110410	11农发10	2012-01-13	102.46	500,000	51,230,000.00
1180164	11铁道08	2012-01-13	101.49	500,000	50,745,000.00
110207	11国开07	2012-01-10	100.06	500,000	50,030,000.00
110207	11国开07	2012-01-13	100.06	500,000	50,030,000.00
1080059	10金坛债	2012-01-09	94.24	400,000	37,696,000.00
110218	11国开18	2012-01-13	101.31	350,000	35,458,500.00
1180014	11新乡投资债	2012-01-05	97.61	250,000	24,402,500.00
1182321	11东钦MTN1	2012-01-06	101.05	200,000	20,210,000.00
1182317	11绍交投MTN1	2012-01-06	100.04	200,000	20,008,000.00
1180001	11金城债	2012-01-05	97.01	200,000	19,402,000.00
1080065	10武汉高科债	2012-01-06	92.88	200,000	18,576,000.00
110218	11国开18	2012-01-10	101.31	150,000	15,196,500.00
1180153	11新投债	2012-01-06	100.54	150,000	15,081,000.00
1180053	11宝城投债	2012-01-06	98.15	100,000	9,815,000.00
1180153	11新投债	2012-01-09	100.54	50,000	5,027,000.00
合计		-	-	-	719,267,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2011年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额683,999,971.40元,于2012年1月6日前先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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

(i)金融工具公允价值计量的方法

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)。

(ii)各层次金融工具公允价值

于2011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1,231,093,552.87元,属于第二层级的余额为1,867,331,931.50元,无属于第三层级的余额。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	56,295,467.99	1.74
	其中:股票	56,295,467.99	1.74
2	固定收益投资	3,042,130,016.38	93.87
	其中:债券	3,042,130,016.38	93.87
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	63,395,139.07	1.96
6	其他各项资产	79,131,720.53	2.44
7	合计	3,240,952,343.97	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	7,870,877.88	0.43
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	7,870,877.88	0.43
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	48,424,590.11	2.62
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	56,295,467.99	3.05

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	000783	长江证券	6,500,000	46,475,000.00	2.52
2	601100	恒立油缸	471,028	7,870,877.88	0.43
3	601336	新华保险	69,953	1,949,590.11	0.11

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	000783	长江证券	88,690,000.00	4.80
2	600886	国投电力	17,291,520.75	0.94
3	601100	恒立油缸	10,833,644.00	0.59
4	601336	新华保险	1,626,407.25	0.09
5	002563	森马服饰	100,500.00	0.01
6	300257	开山股份	94,500.00	0.01
7	300197	铁汉生态	33,790.00	0.00
8	002566	益盛药业	19,950.00	0.00
9	601199	江南水务	18,800.00	0.00
10	002565	上海绿新	15,600.00	0.00

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	600886	国投电力	16,280,313.19	0.88
2	000783	长江证券	3,631,906.72	0.20
3	300257	开山股份	113,040.00	0.01
4	002563	森马服饰	80,550.00	0.00
5	300197	铁汉生态	39,250.00	0.00
6	601199	江南水务	19,670.00	0.00
7	002566	益盛药业	16,269.00	0.00
8	002565	上海绿新	13,825.50	0.00

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	118,724,712.00
卖出股票的收入(成交)总额	20,194,824.41

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	-	-
3	金融债券	426,642,000.00	23.10
	其中:政策性金融债	426,642,000.00	23.10
4	企业债券	2,322,870,406.50	125.76
5	企业短期融资券	10,064,000.00	0.54
6	中期票据	40,218,000.00	2.18
7	可转债	242,335,609.88	13.12
8	其他	-	-
9	合计	3,042,130,016.38	164.70

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	1180164	11铁道08	2,000,000	202,980,000.00	10.99
2	110258	11国开58	1,500,000	153,780,000.00	8.33
3	122840	11临汾债	1,500,000	142,440,000.00	7.71
4	110218	11国开18	1,200,000	121,572,000.00	6.58
5	110207	11国开07	1,000,000	100,060,000.00	5.42

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	7,412.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	79,124,308.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,131,720.53

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	75,664,000.00	4.10
2	110015	石化转债	70,357,000.00	3.81
3	113002	工行转债	63,876,000.00	3.46
4	125887	中鼎转债	9,408,210.95	0.51
5	125731	美丰转债	7,247,380.00	0.39
6	110013	国投转债	6,284,941.20	0.34
7	126729	燕京转债	4,890,077.73	0.26
8	110016	川投转债	4,608,000.00	0.25

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601100	恒立油缸	7,870,877.88	0.43	网下新股申购
2	601336	新华保险	1,949,590.11	0.11	网下新股申购

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
10,706	177,011.56	1,280,258,702.76	67.56%	614,827,046.47	32.44%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	上海国际信托(上信-CB-2119)	400,027,000.00	21.11%
2	中诚信托有限责任公司-交行固定收益	100,006,000.00	5.28%
3	浦发长江金色晚晴计划现金增强组合-长江	70,006,350.00	3.69%
4	中海信托股份有限公司-保证金1号	70,004,650.00	3.69%
5	宏源证券股份有限公司	50,005,250.00	2.64%
6	齐鲁证券有限公司	50,004,250.00	2.64%
7	中国平安人寿保险股份有限公司	50,002,500.00	2.64%
8	华泰联合证券有限责任公司	46,293,067.00	2.44%
9	光大证券股份有限公司	39,456,552.00	2.08%
10	浦发长江金色晚晴计划稳健配置组合-长江	30,002,150.00	1.58%

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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: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,任命战龙先生担任公司总经理。2011年8月22日本基金管理人发布公告,经公司第二届董事会第三十次会议审议通过,任命苏奋先生担任公司督察长,吴建中先生不再担任公司督察长。

2、基金托管人的重大人事变动:2011年1月21日,中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格(证监许可[2011]116号),张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内,未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 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,本期审计费用为85,500元。该审计机构首次为本基金提供审计服务。

10.6 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,本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
招商证券股份有限公司	1	16,299,983.19	80.71%	13,855.02	81.41%	-
光大证券股份有限公司	1	3,894,841.22	19.29%	3,164.63	18.59%	-

10.7.2 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
招商证券股份有限公司	2,320,466,184.22	95.52%	78,848,400,000.00	99.96%	-	-
光大证券股份有限公司	108,858,193.97	4.48%	28,000,000.00	0.04%	-	-

注:1、报告期内,本基金交易单元均为新增交易单元;

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、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。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一二年三月三十日