

交银施罗德趋势优先股票证券投资基金
2011 年半年度报告
2011 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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一一年八月二十四日

1 重要提示及目录

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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 18 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 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	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	38
7.8 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	38
7.9 投资组合报告附注	39
8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	40
9 开放式基金份额变动	40
10 重大事件揭示	40

10.1	基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4	基金投资策略的改变	40
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	40
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8	其他重大事件	42
11	备查文件目录	43
11.1	备查文件目录	43
11.2	存放地点	43
11.3	查阅方式	44

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德趋势优先股票证券投资基金	
基金简称	交银趋势股票	
基金主代码	519702	
交易代码	519702(前端)	519703(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年12月22日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,315,521,023.93份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力图通过把握中国人口变化的重大趋势，精选受益其中的优势行业和个股，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，在分析和判断未来人口趋势的重大转变对国民消费倾向、国家收入分配政策、产业升级和区域发展方向等战略决策的重要影响以及其中所蕴涵的行业投资机会的基础上，挖掘受益其中的优势行业，精选个股，以谋求超额收益。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率。
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，属于基金中的高风险品种，本基金的风险与预期收益高于混合型基金和债券型基金。

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	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	陈超	赵会军
	联系电话	021-61055050	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95588
传真		021-61055034	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区银城中 路 188 号交通银行大楼 二层（裙）	北京市西城区复兴门内 大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大 道 201 号渣打银行大厦 10 楼	北京市西城区复兴门内 大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		钱文挥	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露 报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正 文的管理人互联网网址	www.jyfund.com, www.jysld.com, www.bocomschroder.com
基金半年度报告备置地 点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公 司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）
本期已实现收益	-12,510,090.20
本期利润	-98,065,384.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0405

本期加权平均净值利润率	-4.14%
本期基金份额净值增长率	-4.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	-98,139,445.47
期末可供分配基金份额利润	-0.042
期末基金资产净值	2,217,381,578.46
期末基金份额净值	0.958
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-4.20%

注：1、本基金基金合同生效日为2010年12月22日，基金合同生效日至本报告期末，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
过去一个月	3.79%	1.13%	1.05%	0.90%	2.74%	0.23%
过去三个月	-2.54%	0.99%	-4.01%	0.83%	1.47%	0.16%
过去六个月	-4.49%	0.80%	-1.54%	0.93%	-2.95%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-4.20%	0.78%	-4.33%	0.93%	0.13%	-0.15%

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

交银施罗德趋势优先股票证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2010年12月22日至2011年6月30日）



注：本基金基金合同生效日为2010年12月22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2011年6月30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。

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6月30日，公司已经发行并管理的基金共有十五只：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）和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）。

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		
管华雨	本基金的基金经理、交银施罗德成长股票证券投资基金基金经理、公司权益部副总经理	2010-12-22	-	9年	管华雨先生，CFA，博士学历。历任申银万国证券股份有限公司投资部投资经理、高级投资经理，信诚基金管理有限公司分析师、基金经理助理和基金经理。其中2007年5月至2010年5月担任信诚四季红混合型证券投资基金基金经理。2010年加入交银施罗德基金管理有限公司。
张迎军	本基金的基金经理、交银施罗德保本混合型证券投资基金基金经理、公司固定收益部副总经理	2011-05-03	-	11年	张迎军先生，经济学硕士。历任申银万国证券研究所市场研究部、策略研究部研究员，中国太平洋保险（集团）股份有限公司资金运用管理中心投资经理，太平洋资产管理有限公司组合管理部组合经理。2008年加入交银施罗德基金管理有限公司。
黄义志	本基金的基	2010-12-22	2011-03-30	10年	黄义志先生，复旦大

	金经理助理、 交银施罗德 先进制造股 票证券投资 基金基金经 理			学经济学硕士。历任海通证券股份有限公司研究所分析师、高级分析师，申万菱信基金管理有限公司（原申万巴黎基金管理有限公司）分析师、基金经理助理。2008 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任投资研究部高级分析师、基金经理助理。
--	---	--	--	--

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合规守信情况的说明

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

本投资组合与公司旗下同属于中高风险投资风格的证券投资基金交银稳健之间 2011 年半年度业绩表现差异为 7.02%。差异主要来源于不同基金经理投资风格、行业配

置和选股策略上的不同。无不公平交易因素。

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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年股票市场走出先扬后抑走势，市场投资机会总体有限。一方面通胀高企，政策紧缩力度加大；另一方面经济增长依然强劲。市场风格在一季度从成长股向周期股、从中小市值股票向低市盈率大市值股票发生转换。二季度创业板、中小板绝大多数股票跌幅较大。作为一只次新成立的基金，本基金在 2011 年初对市场较为谨慎，保持了较低的股票仓位。进入 2 月份，由于意识到宏观经济大幅下滑和政策超调的风险显著降低，本基金开始大幅度建仓。建仓总体策略立足于中长期视角，选择具有处于持续景气周期、竞争格局良好、估值合理及商业模式上具有亮点的行业与个股，重点布局了建筑建材、食品饮料、医药、工程机械、金融、家电等行业相关个股，获得了一定的相对超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.958 元，本报告期份额净值增长率为 -4.49%，同期业绩比较基准增长率为 -1.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年下半年股票市场，当前市场的核心焦点还是在于通胀的未来趋势。目前市场多数投资者一致预期 6、7 月通胀见顶回落。但实际通胀情况可能与多数投资者预期发生一定偏离。在二季度经济数据好于预期且通胀压力没有明显缓解的背景下，货币政策放松的可能性较小。从流动性角度分析，M1、M2 环比来看，二季度成为全年流动性最紧时期的概率相对较大，流动性对市场估值的继续收缩将会有限。而过去两年估值的持续收缩，目前多数传统行业龙头公司的估值水平已处于中长期较为合理的水平。虽然紧缩政策会导致一定的经济减速，但 2011 年全年上市公司业绩总体维持增长还是大概率事件，优秀的龙头公司可能获得更高的增长。未来股票市场上涨的主要动力可能主要不是来自于政策放松带来的流动性推动，而是上市公司业绩增长导致的盈利驱动。因此，只要通胀趋势是在预期可控的前提下，预计下半年股票市场的整体环境将会好于上半年。在合理估值基础上买入持有，赚取上市公司业绩增长驱动的股价上涨可能是未来一段时间股票投资的主要盈利模式。本基金将力争把握股票市场出现的投资机会，努力为基金投资人创造较好的业绩回报。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

截止本报告期末，根据相关法律法规及基金合同的约定，本基金本报告期无应分配但尚未实施分配的利润。

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

2011年上半年，本基金托管人在对交银施罗德趋势优先股票证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

2011年上半年，交银施罗德趋势优先股票证券投资基金的管理人——交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德趋势优先股票证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，交银施罗德趋势优先股票证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对交银施罗德基金管理有限公司编制和披露的交银施罗德趋势优先股票证券投资基金2011年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

2011年8月18日

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德趋势优先股票证券投资基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	44,209,434.35	951,392,198.45
结算备付金		1,564,275.21	-
存出保证金		2,228,819.18	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,053,629,833.07	271,820,029.75
其中：股票投资		1,946,392,833.07	271,820,029.75
基金投资		-	-
债券投资		107,237,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	80,000,260.00	1,479,755,180.89
应收证券清算款		40,007,793.18	-
应收利息	6.4.7.5	1,686,667.80	822,145.85
应收股利		820,637.16	-
应收申购款		131,685.07	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,224,279,405.02	2,703,789,554.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	35,027,421.66
应付赎回款		2,720,706.85	-
应付管理人报酬		2,561,591.62	983,396.21
应付托管费		426,931.95	163,899.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	933,556.86	224,114.74
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	255,039.28	20,000.00
负债合计		6,897,826.56	36,418,831.98
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,315,521,023.93	2,659,781,045.37
未分配利润	6.4.7.10	-98,139,445.47	7,589,677.59
所有者权益合计		2,217,381,578.46	2,667,370,722.96
负债和所有者权益总计		2,224,279,405.02	2,703,789,554.94

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值0.958元，基金份额总额2,315,521,023.93份。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德趋势优先股票证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011 年6月30日
一、收入		-72,922,021.71
1. 利息收入		9,396,907.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,855,605.45
债券利息收入		1,320,239.70
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		6,221,062.20
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,586,949.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-9,170,536.79

基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,916,831.80
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	9,840,654.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-85,555,294.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	649,415.78
减：二、费用		25,143,362.51
1. 管理人报酬		17,680,655.94
2. 托管费		2,946,776.09
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	4,279,060.49
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	236,869.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-98,065,384.22
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-98,065,384.22

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德趋势优先股票证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30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）	2,659,781,045.37	7,589,677.59	2,667,370,722.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-98,065,384.22	-98,065,384.22
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）	-344,260,021.44	-7,663,738.84	-351,923,760.28

其中：1. 基金申购款	178,586,822.72	-10,982,484.00	167,604,338.72
2. 基金赎回款	-522,846,844.16	3,318,745.16	-519,528,099.00
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)	2,315,521,023.93	-98,139,445.47	2,217,381,578.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德趋势优先股票证券投资基金(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]1477号《关于核准交银施罗德趋势优先股票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《交银施罗德趋势优先股票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 2,658,553,177.07 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 399 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金合同》于 2010 年 12 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,659,781,045.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,227,868.30 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、招募说明书及其定期更新的有关规定，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 60%-95%；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 5%-40%，其中基金持有的权证不超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金和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：75%×沪深 300 指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率。

6.4.2 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》、《交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金合同》和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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年上半年度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 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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股票投资和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：

(a) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

(b) 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2011年6月30日
活期存款	44,209,434.35
定期存款	-
其他存款	-
合计	44,209,434.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,023,999,580.79	1,946,392,833.07	-77,606,747.72
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	107,035,820.00	107,237,000.00
	合计	107,035,820.00	107,237,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,131,035,400.79	2,053,629,833.07	-77,405,567.72

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上交所	40,000,000.00	-
银行间	40,000,260.00	-
合计	80,000,260.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	18,094.66
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	703.90
应收债券利息	1,583,436.41
应收买入返售证券利息	84,432.83
应收申购款利息	-
其他	-
合计	1,686,667.80

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	932,696.86
银行间市场应付交易费用	860.00
合计	933,556.86

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10,260.00
应付后端申购费	1,628.00
审计费	54,547.97
信息披露费	188,603.31
合计	255,039.28

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,659,781,045.37	2,659,781,045.37
本期申购	178,586,822.72	178,586,822.72
本期赎回（以“-”号填列）	-522,846,844.16	-522,846,844.16
本期末	2,315,521,023.93	2,315,521,023.93

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-560,048.71	8,149,726.30	7,589,677.59
本期利润	-12,510,090.20	-85,555,294.02	-98,065,384.22
本期基金份额交易产生的变动数	-362,900.74	-7,300,838.10	-7,663,738.84
其中：基金申购款	-415,888.18	-10,566,595.82	-10,982,484.00
基金赎回款	52,987.44	3,265,757.72	3,318,745.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,433,039.65	-84,706,405.82	-98,139,445.47

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日

活期存款利息收入	1,795,175.61
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	59,422.74
其他	1,007.10
合计	1,855,605.45

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	817,631,795.36
减：卖出股票成本总额	826,802,332.15
买卖股票差价收入	-9,170,536.79

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	175,991,302.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	168,546,700.00
减：应收利息总额	5,527,770.50
债券投资收益	1,916,831.80

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,840,654.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,840,654.17

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-85,555,294.02
——股票投资	-85,756,474.02
——债券投资	201,180.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-85,555,294.02

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	648,678.98
基金转出费收入	736.80
合计	649,415.78

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产；

2. 基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	4,277,510.49
银行间市场交易费用	1,550.00
合计	4,279,060.49

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日

审计费用	54,547.97
信息披露费	168,603.31
银行划款手续费	8,843.71
债券托管帐户维护费	4,500.00
其他	375.00
合计	236,869.99

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,680,655.94
其中：支付销售机构的客户维护费	4,450,317.79

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,946,776.09

注：支付基金托管人中国工商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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
期初持有的基金份额	20,001,800.00
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	20,001,800.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.86%

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.10.4.2 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未投资本基金。

6.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	44,209,434.35	1,795,175.61

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金无利润分配。

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期内本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000759	中百集团	2011-04-14	重大重组事项	12.32	-	-	4,202,196	59,349,748.61	51,771,054.72	-

注：本基金截至2011年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票型基金，力图通过把握中国人口变化的重大趋势，精选受益其中的优势行业和个股，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，属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险的品种。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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要有风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境内交易所进行的债券交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处

的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末					
2011年6月30日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	44,209,434.35	-	-	-	44,209,434.35
结算备付金	1,564,275.21	-	-	-	1,564,275.21
存出保证金	2,228,819.18	-	-	-	2,228,819.18
交易性金融资产	107,237,000.00	-	-	1,946,392,833.07	2,053,629,833.07
买入返售金融资产	80,000,260.00	-	-	-	80,000,260.00
应收证券清算款	-	-	-	40,007,793.18	40,007,793.18
应收股利	-	-	-	820,637.16	820,637.16
应收利息	-	-	-	1,686,667.80	1,686,667.80
应收申购款	-	-	-	131,685.07	131,685.07
资产总计	235,239,788.74	-	-	1,989,039,616.28	2,224,279,405.02
负债					
卖出回购金融资产	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,720,706.85	2,720,706.85
应付管理人报酬	-	-	-	2,561,591.62	2,561,591.62
应付托管费	-	-	-	426,931.95	426,931.95
应付交易费用	-	-	-	933,556.86	933,556.86
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	255,039.28	255,039.28
负债总计	-	-	-	6,897,826.56	6,897,826.56
利率敏感度缺口	235,239,788.74	-	-	1,982,141,789.72	2,217,381,578.46
本期末					
2010年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	951,392,198.45	-	-	-	951,392,198.45
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	271,820,029.75	271,820,029.75
买入返售金融资产	1,479,755,180.89	-	-	-	1,479,755,180.89
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	822,145.85	822,145.85
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	2,431,147,379.34	-	-	272,642,175.60	2,703,789,554.94
负债					
卖出回购金融资产	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	35,027,421.66	35,027,421.66
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	983,396.21	983,396.21
应付托管费	-	-	-	163,899.37	163,899.37
应付交易费用	-	-	-	224,114.74	224,114.74
应交税费	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	36,418,831.98	36,418,831.98
利率敏感度缺口	2,431,147,379.34	-	-	236,223,343.62	2,667,370,722.96

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.84%（2010 年 12 月 31 日：17.31%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统，结合定性分析和定量分析，形成对不同市场的预测和判断，确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整股票资产、债券资产和货币市场工具的比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，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证券品种占基金资产的比例为 5%-40%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产-股票投资	1,946,392,833.07	87.78	271,820,029.75	10.19
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,946,392,833.07	87.78	271,820,029.75	10.19

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深300”指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	“沪深300”指数上升5%	增加约6,017	-
	“沪深300”指数下降5%	减少约6,017	-

注：由于截至2010年12月31日，本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

7 投资组合报告

7.1 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	1,946,392,833.07	87.51
	其中：股票	1,946,392,833.07	87.51
2	固定收益投资	107,237,000.00	4.82
	其中：债券	107,237,000.00	4.82
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	80,000,260.00	3.60
	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	45,773,709.56	2.06
6	其他各项资产	44,875,602.39	2.02
7	合计	2,224,279,405.02	100.00

7.2 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	39,423,568.80	1.78
B	采掘业	93,234,993.38	4.20
C	制造业	1,159,301,737.45	52.28
C0	食品、饮料	221,486,141.07	9.99
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	16,759,424.70	0.76
C5	电子	66,300,937.64	2.99
C6	金属、非金属	190,411,256.09	8.59
C7	机械、设备、仪表	414,361,819.99	18.69
C8	医药、生物制品	249,982,157.96	11.27
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	115,465,981.10	5.21
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	40,729,962.02	1.84
H	批发和零售贸易	120,568,334.33	5.44
I	金融、保险业	283,884,951.93	12.80
J	房地产业	75,731,627.62	3.42
K	社会服务业	18,051,676.44	0.81
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,946,392,833.07	87.78

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600036	招商银行	8,499,924	110,669,010.48	4.99
2	000157	中联重科	6,499,819	99,967,216.22	4.51
3	600276	恒瑞医药	2,568,715	76,984,388.55	3.47
4	600519	贵州茅台	359,865	76,518,094.95	3.45
5	600000	浦发银行	7,150,000	70,356,000.00	3.17
6	002304	洋河股份	547,962	69,130,885.92	3.12
7	600031	三一重工	3,749,690	67,644,407.60	3.05
8	002129	中环股份	3,300,196	66,300,937.64	2.99
9	601699	潞安环能	2,013,898	66,075,993.38	2.98
10	600859	王府井	1,649,113	65,915,046.61	2.97
11	000401	冀东水泥	2,499,919	62,472,975.81	2.82
12	600585	海螺水泥	2,249,978	62,459,389.28	2.82
13	002123	荣信股份	2,400,435	54,681,909.30	2.47
14	600016	民生银行	9,500,000	54,435,000.00	2.45
15	000538	云南白药	910,028	51,944,398.24	2.34
16	000759	中百集团	4,202,196	51,771,054.72	2.33
17	000651	格力电器	2,149,787	50,519,994.50	2.28
18	000527	美的电器	2,699,864	49,650,498.96	2.24
19	600535	天士力	1,092,040	44,915,605.20	2.03
20	000568	泸州老窖	928,742	41,904,839.04	1.89
21	601118	海南橡胶	3,199,965	39,423,568.80	1.78
22	000338	潍柴动力	851,847	38,699,409.21	1.75
23	600383	金地集团	5,954,127	38,165,954.07	1.72
24	600064	南京高科	2,712,323	37,565,673.55	1.69
25	600318	巢东股份	1,845,564	36,708,267.96	1.66
26	000858	五粮液	949,953	33,932,321.16	1.53
27	000776	广发证券	849,682	33,350,018.50	1.50
28	600332	广州药业	2,099,913	33,031,631.49	1.49
29	002375	亚厦股份	1,085,353	32,017,913.50	1.44
30	002482	广田股份	1,059,736	31,993,429.84	1.44
31	600879	航天电子	2,399,912	29,182,929.92	1.32
32	600488	天药股份	3,599,972	28,871,775.44	1.30
33	002081	金螳螂	684,836	27,530,407.20	1.24
34	600028	中国石化	3,300,000	27,159,000.00	1.22
35	002431	棕榈园林	907,596	23,924,230.56	1.08

36	300012	华测检测	1,047,081	18,051,676.44	0.81
37	600143	金发科技	999,945	16,459,094.70	0.74
38	601818	光大银行	4,499,977	15,074,922.95	0.68
39	600231	凌钢股份	1,610,842	14,690,879.04	0.66
40	300025	华星创业	1,007,430	14,517,066.30	0.65
41	300006	莱美药业	331,958	14,234,359.04	0.64
42	002065	东华软件	599,927	14,218,269.90	0.64
43	600801	华新水泥	549,990	14,079,744.00	0.63
44	002202	金风科技	849,796	12,687,454.28	0.57
45	300177	中海达	294,058	11,994,625.82	0.54
46	000800	一汽轿车	800,000	11,328,000.00	0.51
47	600723	西单商场	229,660	2,882,233.00	0.13
48	002450	康得新	14,200	300,330.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	113,100,808.27	4.24
2	000157	中联重科	98,744,874.89	3.70
3	600000	浦发银行	81,787,740.64	3.07
4	000338	潍柴动力	73,466,338.13	2.75
5	002129	中环股份	71,605,146.32	2.68
6	600837	海通证券	70,140,198.24	2.63
7	600031	三一重工	70,049,815.13	2.63
8	601699	潞安环能	68,711,402.27	2.58
9	000401	冀东水泥	66,505,193.92	2.49
10	600519	贵州茅台	66,146,221.13	2.48
11	600016	民生银行	63,360,227.04	2.38
12	002123	荣信股份	62,667,346.47	2.35
13	000983	西山煤电	62,654,412.62	2.35
14	000759	中百集团	59,349,748.61	2.23
15	600383	金地集团	59,044,657.52	2.21
16	000568	泸州老窖	57,422,712.21	2.15

17	600585	海螺水泥	56,139,137.13	2.10
18	000527	美的电器	52,600,444.20	1.97
19	600276	恒瑞医药	52,282,791.02	1.96
20	601169	北京银行	51,566,264.52	1.93

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。

7.4.2 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

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600518	康美药业	67,605,936.51	2.53
2	600837	海通证券	66,820,010.41	2.51
3	000983	西山煤电	52,154,574.72	1.96
4	601169	北京银行	47,308,465.28	1.77
5	000001	深发展 A	46,469,799.49	1.74
6	600535	天士力	39,352,704.03	1.48
7	000998	隆平高科	33,954,816.57	1.27
8	600111	包钢稀土	29,331,741.86	1.10
9	002304	洋河股份	26,062,017.05	0.98
10	002202	金风科技	25,265,397.36	0.95
11	600256	广汇股份	24,613,757.57	0.92
12	000968	煤气化	24,232,043.80	0.91
13	600547	山东黄金	23,640,849.15	0.89
14	000338	潍柴动力	21,516,537.52	0.81
15	002028	思源电气	20,987,392.51	0.79
16	600879	航天电子	20,700,576.43	0.78
17	600383	金地集团	18,682,640.81	0.70
18	600723	西单商场	18,547,730.51	0.70
19	000568	泸州老窖	17,861,332.15	0.67
20	000933	神火股份	17,002,071.54	0.64

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。

7.4.3 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	2,587,131,609.49
卖出股票的收入（成交）总额	817,631,795.36

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。

7.5 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	107,237,000.00	4.84
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	107,237,000.00	4.84

7.6 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	1001090	10 央行票据 90	500,000	48,755,000.00	2.20
2	1001080	10 央行票据 80	300,000	29,295,000.00	1.32
3	1001077	10 央行票据 77	200,000	19,536,000.00	0.88
4	1101028	11 央行票据 28	100,000	9,651,000.00	0.44

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	2,228,819.18
2	应收证券清算款	40,007,793.18
3	应收股利	820,637.16
4	应收利息	1,686,667.80
5	应收申购款	131,685.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,875,602.39

7.9.4 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。

7.9.5 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。

7.9.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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

24,077	96,171.49	479,529,485.33	20.71%	1,835,991,538.60	79.29%
--------	-----------	----------------	--------	------------------	--------

8.2 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	2,335,409.83	0.10%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年12月22日）基金份额总额	2,659,781,045.37
本报告期期初基金份额总额	2,659,781,045.37
本报告期基金总申购份额	178,586,822.72
减：本报告期基金总赎回份额	522,846,844.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,315,521,023.93

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。

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，任命战龙先生担任本公司总经理。

2、报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、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 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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。

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	
长江证券股份有限公司	1	1,118,896,252.72	32.92%	909,110.18	32.15%	-
北京高华证券有限责任公司	1	1,077,914,890.01	31.72%	916,222.37	32.41%	-
华创证券有限责任公司	2	579,730,072.38	17.06%	475,463.92	16.82%	-
国开证券有限责任公司	1	531,394,570.29	15.64%	451,687.02	15.98%	-
齐鲁证券有限公司	2	35,078,189.94	1.03%	28,501.13	1.01%	-
东吴证券股份有限公司	1	25,193,022.01	0.74%	21,413.74	0.76%	-
广发证券股份有限公司	1	20,376,546.12	0.60%	16,556.45	0.59%	-
东方证券股份有限公司	1	9,946,395.62	0.29%	8,454.42	0.30%	-
民生证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

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
北京高华证	-	-	2,621,900,000.00	69.24%	-	-

券有限责任公司						
华创证券有限责任公司	16,467,096.80	76.84%	345,000,000.00	9.11%	-	-
国开证券有限责任公司	4,964,205.50	23.16%	730,000,000.00	19.28%	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	90,000,000.00	2.38%	-	-

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德趋势优先股票证券投资基金开放日常申购、赎回业务并参与部分代销机构前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-2-21
2	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德趋势优先股票证券投资基金开放定期定额投资业务并参与部分代销机构该业务前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-2-21
3	关于交银施罗德趋势优先股票证券投资基金在中国农业银行股份有限公司开办定期定额赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-2-21
4	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发华福证券有限责任公司定期定额投资业务前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-3-9
5	交银施罗德基金管理有限公司关于增加开通旗下基金在部分代销机构代销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-4-1
6	交银施罗德基金管理有限公司关于中国工商银行延长其个人电子银行基金前端申购	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-4-1

	费率优惠活动的公告		
7	交银施罗德趋势优先股票证券投资基金2011年第一季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-4-22
8	交银施罗德基金管理有限公司关于增聘张迎军先生为交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-5-3
9	交银施罗德基金管理有限公司关于增加开通旗下基金在部分代销机构代销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-5-6
10	交银施罗德基金管理有限公司关于开通基金网上直销通联支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-5-25
11	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德趋势优先股票证券投资基金开放日常转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-5-27
12	交银施罗德基金管理有限公司关于开通旗下部分基金基金转换业务及调整基金转换业务规则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-5-27
13	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司基金前端申购费率优惠活动延期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-6-30

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准交银施罗德趋势优先股票证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德趋势优先股票证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德趋势优先股票证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集交银施罗德趋势优先股票证券投资基金之法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德趋势优先股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.jyfund.com, www.jysld.com, www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一一年八月二十四日