

交银施罗德信用添利债券证券投资基金

2012 年年度报告

2012 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：二〇一三年三月二十八日

§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 2013 年 3 月 27 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。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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的说明	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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 审计报告	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	38
8.1 期末基金资产组合情况	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
8.3 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	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	41
8.7 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	41
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	41

8.9 投资组合报告附注	41
§9 基金份额持有人信息	42
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
9.2 期末上市基金前十名持有人	42
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	44
§11 备查文件目录	45
11.1 备查文件目录	45
11.2 存放地点	45
11.3 查阅方式	45

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德信用添利债券证券投资基金
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	010-66060069
	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
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）	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		钱文挥	蒋超良

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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、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	2012 年	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	137,380,272.44	56,295,237.38
本期利润	261,757,377.10	-48,020,542.45
加权平均基金份额本期利润	0.1381	-0.0253
本期加权平均净值利润率	13.25%	-2.55%
本期基金份额净值增长率	14.24%	-2.50%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末
期末可供分配利润	129,242,590.98	-48,020,542.45
期末可供分配基金份额利润	0.068	-0.025
期末基金资产净值	2,044,389,665.04	1,847,065,206.78
期末基金份额净值	1.079	0.975
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	11.38%	-2.50%

注：1、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；

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。

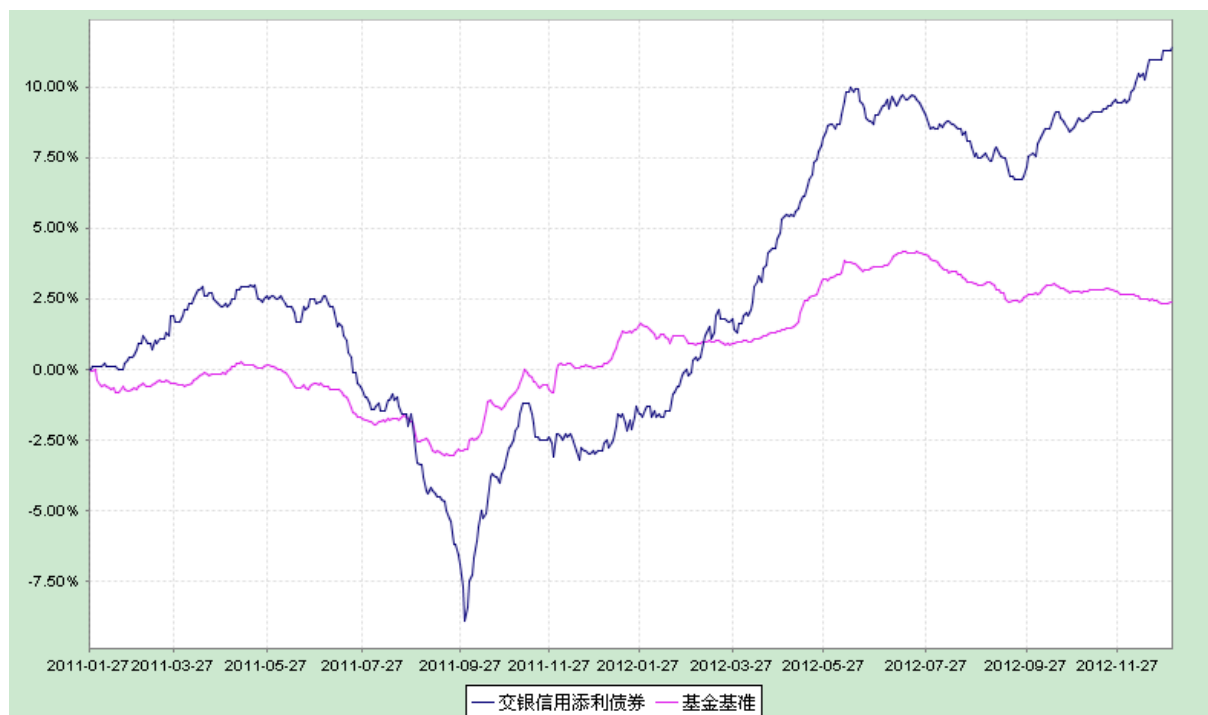
3.2 基金净值表现

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

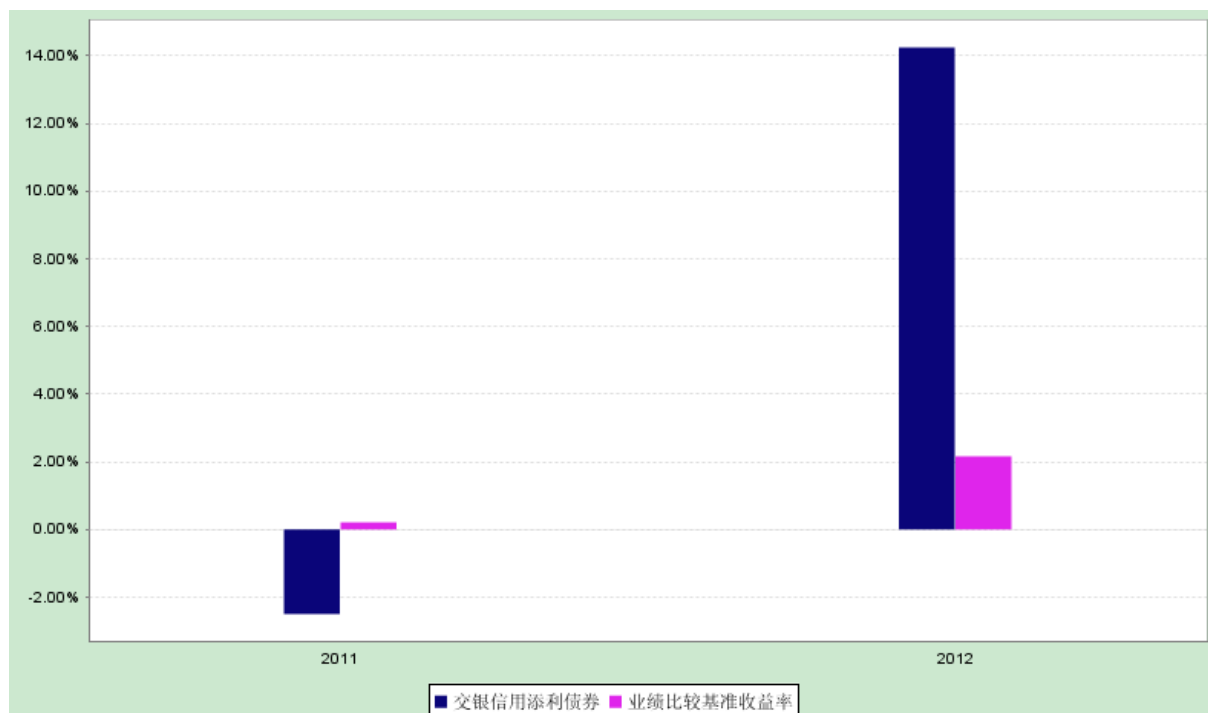
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.45%	0.13%	-0.26%	0.04%	3.71%	0.09%
过去六个月	2.18%	0.15%	-1.22%	0.05%	3.40%	0.10%
过去一年	14.24%	0.20%	2.16%	0.07%	12.08%	0.13%
自基金合同生效起至今	11.38%	0.24%	2.37%	0.09%	9.01%	0.15%

注：本基金的业绩比较基准为 $80\% \times \text{中债企业债总全价指数收益率} + 20\% \times \text{中债国债总全价指数收益率}$ ，每日进行再平衡过程。

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



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 2012 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	现金形式发放	再投资形式发放	年度利润分配	备注
----	-------	--------	---------	--------	----

	金份额分 红数	总额	总额	合计	
2012年	0.340	64,432,918.84	-	64,432,918.84	-
2011年	-	-	-	-	-
合计	0.340	64,432,918.84	-	64,432,918.84	-

§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 2012 年 12 月 31 日，公司已经发行并管理的基金共有二十四只：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）、交银施罗德优势行业灵活配置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）、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）、交银施罗德全球自然资源证券投资基金（基金合同生效日：2012 年 5 月 22 日）、交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金（基金合同生效日：2012 年 6 月 20 日）、交银施罗德阿尔法核心股票型证券投资基金（基金合同生效日：2012 年 8 月 3 日）、交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金（基金合同生效日：2012 年 11 月 5 日）、交银施罗德沪深 300 行业分层等权重指数证券投资基金（基金合同生效日：2012 年 11 月 7 日）和交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金（基金合同生效日：2012 年 12 月 19 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（助理）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、交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金基金经理	2011-01-27	-	8 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（助理）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（助理）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循《中华人民共和国证券投资基金法》、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 公平交易制度和控制方法

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下所管理的所有资产组合投资运作的公平。旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下：

（1）公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

（2）公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、

比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

(3) 公司建立了清晰的投资授权制度,明确各层级投资决策主体的职责和权限划分,组合投资经理充分发挥专业判断能力,不受他人干预,在授权范围内独立行使投资决策权,维护公平的投资管理环境,维护所管理投资组合的合法利益,保证各投资组合交易决策的客观性和独立性,防范不公平及异常交易的发生。

(4) 公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库,制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上,根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等,按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库,组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5) 公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控,风险管理部负责对各投资组合公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等,本基金管理人未发现任何违反公平交易制度的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内本基金与公司旗下所管理的其他主动管理型投资组合不存在同日反向交易的异常交易行为。

本报告期内,本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量 5%的情形,本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

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

2012 年,我国经济总体维持较弱的态势,GDP 逐级小幅向下,资本市场基本贴切地反映了基本面的变化,对经济增长的怀疑与对政策放松预期的博弈使得中国 A 股在前三季度出现震荡向下的走势,而与此对应,固定收益市场则在 2011 年末的行情的基础上向长久期、低信用评级进一步演绎,全年走出一波较大的上涨行情。

而在四季度,我国经济出现企稳且回升态势:10 月、11 月的工业增加值分别为 9.6 和 10.1,PMI 也连续三月处于枯荣线 50 上方。市场在四季度对经济增长的预期向上修正,12 月份权益市场也走出了少有的大幅上涨行情。而债券市场在四季度表现的比较平

稳，中债企业债总全价指数在 12 月份下跌 0.29%，从收益率曲线上看，短端收益上升较为明显，长端下行，期限结构平坦化。从信用层面上看，受年底资金紧张及基本面复苏影响，无风险利率上行，而风险利率小幅下行，信用利差缩窄。债券市场的收益主要来自于票息收入。

本基金在 2012 年保持较高的久期和较好的把握了低信用评级（AA）的上涨机会，全年收益 14.24%。组合在四季度对债券市场持较谨慎态度，主动降低组合的杠杆和久期，以减持长期限的公司债、城投债为主，同时增加短期融资券的持仓。在对固定收益产品保持谨慎态度的同时，组合在四季度的前两个月对可转债持较积极的策略，在 12 月份获得了较好的收益。本基金在 12 月继续增加了短期融资券的配置，同时适当降低可转债的持仓，以期待 2013 年给投资者带来更稳健的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.079 元，本报告期份额净值增长率为 14.24%，同期业绩比较基准增长率为 2.16%。

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 2013 年，对经济增长的修正或仍成为主旋律，在对权益类市场保持较乐观态度同时，对下半年通胀的演绎仍需保持关注。政策或可期待，但债券市场上信用风险的累积同样值得注意。根据目前对市场的判断，组合策略以保持较低久期、适度杠杆为主，债券市场以持有票息收入为主，同时期待市场调整过程中蕴含的机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2012 年度，根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等有关法规，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化监察稽核职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。

本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）全面完善公司内部控制制度和业务流程，提升制度流程的质量和贯彻力度。

本年度公司以提升制度和业务流程的指导性和执行力为强化内部控制的重要抓手，以内部管理制度的全面修订和公司主要业务流程的梳理为工作重点，通过整理完善公司各项制度和业务流程，强化制度流程的规范性、易读性和可操作性，促进公司各项制度流程的有效贯彻，规范公司业务运作，全面强化内部控制。

（二）通过第三方内部控制鉴证，促进公司内部控制体系完善。

为了借助外部专业经验进一步提升公司内部控制水平，公司聘请普华永道中天会计师事务所有限公司对公司内部控制情况进行鉴证，并对公司内部控制情况出具独立鉴证报告。公司内部控制鉴证项目的整体实施，通过内控缺口评估、整改、验收、鉴证的各个阶段，使公司以国际通行标准重新审视内部控制情况，明确了公司投资管理业务相关的内部控制目标、措施，规范了各项内控制度的实施，对公司内部控制体系完善起到了

积极的作用。

（三）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司监察稽核部门本年度通过开展全面覆盖各主要环节的内部审计和检查，检查公司从投资、销售到后台业务各方面运作的合规性和内部控制的有效性。监察稽核部通过对基金投资、销售、运营等部门的内部控制关键点进行定期和不定期检查，促进公司内部控制制度规范、执行有效，风险管理水平不断提升。

4.7 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其适用性的情况后，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求，本基金对本报告期可分配利润进行了一次收益分配，具体情况参见 7.4.11 利润分配情况。

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
123,642,245.20	64,432,918.84	59,209,326.36	一次

本基金于 2013 年 1 月 18 日进行本报告期利润的第二次分红，向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.460 元。本次分红的权益登记日：2013 年 1 月 18 日，场内除息日：2013 年 1 月 21 日，场外除息日：2013 年 1 月 18 日，场内现金红利发放日：2013 年 1 月 21 日，场外现金红利发放日：2013 年 1 月 22 日。本基金此次分配金额为 87,173,946.02 元，此次分红之后，2012 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

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 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半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

2013 年 3 月 27 日

§6 审计报告

普华永道中天审字(2013)第 20242 号

交银施罗德信用添利债券证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的交银施罗德信用添利债券证券投资基金(以下简称“交银施罗德信用添利债券基金”)的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是交银施罗德信用添利债券基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述交银施罗德信用添利债券基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了交银施罗德信用添利债券基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所有限公司
中国·上海市

注册会计师 汪棣

注册会计师 屈斯洁

2013 年 3 月 15 日

§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

第 15 页 共 45 页

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1,616,455.09	1,318,441.63
结算备付金		62,447,721.95	62,076,697.44
存出保证金		5,507.50	7,412.01
交易性金融资产	7.4.7.2	2,816,089,402.00	3,098,425,484.37
其中：股票投资		32,889,237.30	56,295,467.99
基金投资		-	-
债券投资		2,767,294,164.70	3,042,130,016.38
资产支持证券投资		15,906,000.00	-
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		8,643,313.00	-
应收利息	7.4.7.5	58,689,289.47	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		2,947,491,689.01	3,240,952,343.97
负 债 和 所 有 者 权 益	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 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		896,498,552.65	1,388,347,194.87
应付证券清算款		17,502.05	118,728.04
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,031,386.60	939,840.13
应付托管费		343,795.57	313,280.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	47,725.41	38,121.98
应交税费		4,297,768.45	3,149,960.00
应付利息		484,293.24	614,512.13
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	381,000.00	365,500.00
负债合计		903,102,023.97	1,393,887,137.19
所 有 者 权 益：			
实收基金	7.4.7.9	1,895,085,749.23	1,895,085,749.23

未分配利润	7.4.7.10	149,303,915.81	-48,020,542.45
所有者权益合计		2,044,389,665.04	1,847,065,206.78
负债和所有者权益总计		2,947,491,689.01	3,240,952,343.97

注：1、报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.079 元，基金份额总额 1,895,085,749.23 份。

2、比较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。

7.2 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 27 日 (基金合同生效 日)至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		322,399,192.78	-10,519,888.14
1.利息收入		163,175,111.53	112,488,777.61
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,470,768.59	980,951.25
债券利息收入		161,630,473.82	107,013,274.75
资产支持证券利息收入		67,761.85	-
买入返售金融资产收入		6,107.27	4,494,551.61
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		34,846,976.59	-18,702,970.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-11,563,305.40	-3,714,836.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	45,854,300.69	-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	555,981.30	1,890,000.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	124,377,104.66	-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		60,641,815.68	37,500,654.31
1. 管理人报酬		11,838,890.97	10,454,483.51
2. 托管费		3,946,297.03	3,484,827.82
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	371,142.61	77,074.95
5. 利息支出		43,761,401.78	23,005,347.30
其中：卖出回购金融资产支出		43,761,401.78	23,005,347.30

6. 其他费用	7.4.7.20	724,083.29	478,920.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		261,757,377.10	-48,020,542.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		261,757,377.10	-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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	-48,020,542.45	1,847,065,206.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	261,757,377.10	261,757,377.10
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）	-	-64,432,918.84	-64,432,918.84
五、期末所有者权益（基金净值）	1,895,085,749.23	149,303,915.81	2,044,389,665.04
项目	上年度可比期间 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

报表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： $80\% \times \text{中债企业债总全价指数收益率} + 20\% \times \text{中债国债总全价指数收益率}$ 。

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 2013 年 3 月 15 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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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 2012 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度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。比较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、资产支持证券投资和衍生工具(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的债券或资产支持证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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益;在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

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、资产支持证券投资 and 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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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) 本基金的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：

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[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)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

(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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
活期存款	1,616,455.09	1,318,441.63
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	1,616,455.09	1,318,441.63

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		50,022,732.00	32,889,237.30	-17,133,494.70
债券	交易所市场	787,511,453.17	800,204,664.70	12,693,211.53
	银行间市场	1,941,933,892.00	1,967,089,500.00	25,155,608.00
	合计	2,729,445,345.17	2,767,294,164.70	37,848,819.53
资产支持证券		16,560,000.00	15,906,000.00	-654,000.00
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,796,028,077.17	2,816,089,402.00	20,061,324.83

项目		上年度末 2011 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		94,815,051.25	56,295,467.99	-38,519,583.26
债券	交易所市场	1,262,273,835.97	1,214,935,016.38	-47,338,819.59
	银行间市场	1,845,652,376.98	1,827,195,000.00	-18,457,376.98
	合计	3,107,926,212.95	3,042,130,016.38	-65,796,196.57
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,202,741,264.20	3,098,425,484.37	-104,315,779.83

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	8,929.97	3,893.91
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	30,911.65	31,701.20
应收债券利息	58,639,527.10	79,088,713.41
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	9,920.75	-
合计	58,689,289.47	79,124,308.52

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

交易所市场应付交易费用	20,685.66	16,789.30
银行间市场应付交易费用	27,039.75	21,332.68
合计	47,725.41	38,121.98

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提审计费	81,000.00	85,500.00
预提信息披露费	300,000.00	280,000.00
合计	381,000.00	365,500.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,895,085,749.23	1,895,085,749.23
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,895,085,749.23	1,895,085,749.23

7.4.7.10 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	56,295,237.38	-104,315,779.83	-48,020,542.45
本期利润	137,380,272.44	124,377,104.66	261,757,377.10
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-64,432,918.84	-	-64,432,918.84
本期末	129,242,590.98	20,061,324.83	149,303,915.81

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 27 日（基金 合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	255,060.33	480,939.81
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	1,215,708.26	500,011.44
其他	-	-
合计	1,470,768.59	980,951.25

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 27 日（基金合 同生效日）至 2011 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	150,621,381.85	20,194,824.41
减：卖出股票成本总额	162,184,687.25	23,909,660.75
买卖股票差价收入	-11,563,305.40	-3,714,836.34

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年1月27日（基金合同生 效日）至2011年12月31日
卖出债券（债转股及债券 到期兑付）成交总额	4,967,838,385.91	1,109,224,614.80
减：卖出债券（债转股及 债券到期兑付）成本总额	4,840,303,592.66	1,117,853,559.12
减：应收利息总额	81,680,492.56	8,249,189.97
债券投资收益	45,854,300.69	-16,878,134.29

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年1月27日（基金合同生 效日）至2011年12月31日
卖出资产支持证券(还 本)成交总额	3,477,841.10	-
减：卖出资产支持证券 (还本)成本总额	3,420,000.00	-
减：应收利息总额	57,841.10	-

资产支持证券投资收益	0.00	-
------------	------	---

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年1月27日（基金合同生 效日）至2011年12月31日
股票投资产生的股利收益	555,981.30	1,890,000.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	555,981.30	1,890,000.00

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年1月27日（基金合同生 效日）至2011年12月31日
1.交易性金融资产	124,377,104.66	-104,315,779.83
——股票投资	21,386,088.56	-38,519,583.26
——债券投资	103,645,016.10	-65,796,196.57
——资产支持证券投资	-654,000.00	-
——基金投资	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	124,377,104.66	-104,315,779.83

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月27日（基金合同生效日） 至2011年12月31日
基金赎回费收入	-	-
基金转换费收入	-	-
基金合同生效日前 利息收入	-	10,084.71
合计	-	10,084.71

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月27日（基金合同生效日） 至2011年12月31日
交易所市场交易费用	335,442.61	65,074.95
银行间市场交易费用	35,700.00	12,000.00
合计	371,142.61	77,074.95

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月27日（基金合同生效日） 至2011年12月31日
审计费用	81,000.00	85,500.00
信息披露费	300,000.00	280,000.00
银行汇划费用	56,024.55	25,190.73
上市年费	60,000.00	75,000.00
债券账户维护费	33,400.00	12,000.00
分红手续费	193,298.74	-
其他	360.00	1,230.00
合计	724,083.29	478,920.73

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

(1)财政部、国家税务总局、中国证监会于 2012 年 11 月 16 日联合发布财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(以下简称“通知”),要求个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得,按照本通知的规定计征个人所得税。通知自 2013 年 1 月 1 日起施行。

(2)本基金的基金管理人于 2013 年 1 月 14 日宣告分红,向截至 2013 年 1 月 18 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.460 元。

7.4.9 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 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	11,838,890.97	10,454,483.51
其中：支付销售机构的客户维护费	1,296,739.12	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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 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	3,946,297.03	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。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2012年1月1日至2012年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	50,298,838.59	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月27日（基金合同生效日）至2011年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

7.4.10.5 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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	1,616,455.09	255,060.33	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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润分 配 合计	备 注
1	2012-06-27	2012-06-28 (场内)	2012-06-27 (场外)	0.340	64,432,918.84	-	64,432,918.84	-
合计	-	-		0.340	64,432,918.84	-	64,432,918.84	-

注：本基金的基金管理人于资产负债表日后，报告批准报出日前宣告的利润分配情况，请参见附注 7.4.8.2 资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 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 366,498,650.25 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：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
1180014	11新乡投资债	2013-01-09	102.24	1,000,000	102,240,000.00
11234001	12东航股 SCP001	2013-01-04	100.05	700,000	70,035,000.00
1180164	11铁道08	2013-01-10	101.32	500,000	50,660,000.00
1282461	12铁煤MTN1	2013-01-10	101.05	500,000	50,525,000.00
1282373	12汉城投 MTN1	2013-01-10	100.62	500,000	50,310,000.00
1282285	12中石油 MTN3	2013-01-10	99.19	200,000	19,838,000.00
1080046	10内蒙高新债	2013-01-08	101.89	300,000	30,567,000.00

合计		-	-	3,700,000	374,175,000.00
----	--	---	---	-----------	----------------

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 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 529,999,902.40 元，于 2013 年 1 月 7 日(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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型基金，在证券投资基金中属于中等风险的品种，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。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，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。

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由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。

7.4.13.2 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农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的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。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
A-1	375,452,500.00	10,064,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	99,970,000.00	-
合计	475,422,500.00	10,064,000.00

注：未评级部分为超短期融资债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
AAA	479,817,732.10	566,516,372.60
AAA 以下	1,817,490,932.60	2,038,907,643.78
未评级	10,469,000.00	426,642,000.00
合计	2,307,777,664.70	3,032,066,016.38

注：AAA 评级部分含资产支持证券，未评级部分为国债和政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。于封闭期内本基金的流动性风险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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分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 7.4.12 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。

除卖出回购金融资产款余额中有 896,498,552.65 元将在一个月内到期且计息外(该利息金额不重大)，应交税费无固定到期日外，本基金所持有的其他金融负债的合同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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,616,455.09	-	-	-	1,616,455.09
结算备付金	62,447,721.95	-	-	-	62,447,721.95
存出保证金	-	-	-	5,507.50	5,507.50
交易性金融资产	614,481,600.00	1,298,600,331.70	870,118,233.00	32,889,237.30	2,816,089,402.00
应收证券清算款	-	-	-	8,643,313.00	8,643,313.00
应收利息	-	-	-	58,689,289.47	58,689,289.47
资产总计	678,545,777.04	1,298,600,331.70	870,118,233.00	100,227,347.27	2,947,491,689.01
负债					
卖出回购金融资产	896,498,552.65	-	-	-	896,498,552.65
应付证券清算款	-	-	-	17,502.05	17,502.05
应付管理人报酬	-	-	-	1,031,386.60	1,031,386.60

应付托管费	-	-	-	343,795.57	343,795.57
应付交易费用	-	-	-	47,725.41	47,725.41
应交税费	-	-	-	4,297,768.45	4,297,768.45
应付利息	-	-	-	484,293.24	484,293.24
其他负债	-	-	-	381,000.00	381,000.00
负债总计	896,498,552.65	-	-	6,603,471.32	903,102,023.97
利率敏感度缺口	-217,952,775.61	1,298,600,331.70	870,118,233.00	93,623,875.95	2,044,389,665.04
上年度末					
2011 年 12 月 31 日	1 年以内	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,318,441.63	-	-	-	1,318,441.63
结算备付金	62,076,697.44	-	-	-	62,076,697.44
存出保证金	-	-	-	7,412.01	7,412.01
交易性金融资产	181,299,000.00	1,689,241,969.08	1,171,589,047.30	56,295,467.99	3,098,425,484.37
应收利息	-	-	-	79,124,308.52	79,124,308.52
资产总计	244,694,139.07	1,689,241,969.08	1,171,589,047.30	135,427,188.52	3,240,952,343.97
负债					
卖出回购金融资产	1,388,347,194.87	-	-	-	1,388,347,194.87
应付证券清算款	-	-	-	118,728.04	118,728.04
应付管理人报酬	-	-	-	939,840.13	939,840.13
应付托管费	-	-	-	313,280.04	313,280.04
应付交易费用	-	-	-	38,121.98	38,121.98
应交税费	-	-	-	3,149,960.00	3,149,960.00
应付利息	-	-	-	614,512.13	614,512.13
其他负债	-	-	-	365,500.00	365,500.00
负债总计	1,388,347,194.87	-	-	5,539,942.32	1,393,887,137.19
利率敏感度缺口	-1,143,653,055.80	1,689,241,969.08	1,171,589,047.30	129,887,246.20	1,847,065,206.78

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予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2012 年 12 月 31 日	上年末 2011 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 2,252	增加约 3,660
	市场利率上升 25 个基点	减少约 2,220	减少约 3,599

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		上年度末 2011 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	32,889,237.30	1.61	56,295,467.99	3.05
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	32,889,237.30	1.61	56,295,467.99	3.05

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.61%(2011 年 12 月 31 日：3.05%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2011 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14 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 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 833,093,902.00 元，属于第二层级的余额为 1,982,995,500.00 元，无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级 1,231,093,552.87 元，第二层级 1,867,331,931.50 元，无第三层级)。

(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	32,889,237.30	1.12
	其中：股票	32,889,237.30	1.12
2	固定收益投资	2,783,200,164.70	94.43
	其中：债券	2,767,294,164.70	93.89
	资产支持证券	15,906,000.00	0.54
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	64,064,177.04	2.17
6	其他各项资产	67,338,109.97	2.28
7	合计	2,947,491,689.01	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	27,249,237.30	1.33
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	19,300,639.80	0.94
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	7,948,597.50	0.39
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	5,640,000.00	0.28
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	32,889,237.30	1.61

8.3 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	601339	百隆东方	2,322,580	19,300,639.80	0.94
2	601100	恒立油缸	706,542	7,948,597.50	0.39
3	000783	长江证券	600,000	5,640,000.00	0.28

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	600674	川投能源	36,660,000.00	1.98
2	601339	百隆东方	31,587,088.00	1.71
3	600143	金发科技	25,260,000.00	1.37
4	300331	苏大维格	15,600,000.00	0.84
5	000651	格力电器	6,864,000.00	0.37
6	603000	人民网	1,421,280.00	0.08

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	000783	长江证券	53,542,545.29	2.90
2	600674	川投能源	39,193,498.07	2.12
3	600143	金发科技	24,780,476.47	1.34
4	300331	苏大维格	20,244,582.39	1.10
5	000651	格力电器	8,164,319.06	0.44
6	603000	人民网	2,623,575.13	0.14
7	601336	新华保险	2,072,385.44	0.11

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	117,392,368.00
卖出股票的收入（成交）总额	150,621,381.85

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	10,469,000.00	0.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,000,000.00	2.45
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	1,522,927,774.70	74.49
5	企业短期融资券	475,422,500.00	23.25
6	中期票据	361,365,000.00	17.68
7	可转债	347,109,890.00	16.98
8	其他	-	-
9	合计	2,767,294,164.70	135.36

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	1180014	11 新乡投资债	1,000,000	102,240,000.00	5.00
2	110020	南山转债	940,000	99,687,000.00	4.88
3	1080046	10 内蒙高新债	800,000	81,512,000.00	3.99
4	1180164	11 铁道 08	800,000	81,056,000.00	3.96
5	041259055	12 义马 CP001	800,000	80,128,000.00	3.92

8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	061205001	12 上元 1A	200,000	15,906,000.00	0.78

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	5,507.50
2	应收证券清算款	8,643,313.00
3	应收股利	-
4	应收利息	58,689,289.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,338,109.97

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	113003	重工转债	63,468,000.00	3.10
2	110015	石化转债	61,746,000.00	3.02
3	113002	工行转债	43,832,000.00	2.14
4	110003	新钢转债	30,894,000.00	1.51
5	113001	中行转债	28,905,000.00	1.41
6	110016	川投转债	10,876,000.00	0.53
7	125731	美丰转债	6,679,200.00	0.33
8	125887	中鼎转债	1,022,690.00	0.05

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
10,721	176,763.90	1,286,677,806.76	67.90%	608,407,942.47	32.10%

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	中信证券-中信-中信证券稳健回报集合资产	73,050,307.00	3.85%

	管理计划		
4	浦发长江金色晚晴计划现金增强组合-长江	70,006,350.00	3.69%
5	齐鲁证券有限公司	50,004,250.00	2.64%
6	中国平安人寿保险股份有限公司	50,002,500.00	2.64%
7	中油财务有限责任公司	44,875,082.00	2.37%
8	国联证券股份有限公司	42,736,863.00	2.26%
9	新华人寿保险股份有限公司	40,221,067.00	2.12%
10	东证资管-工行-东方红-新睿 2 号集合资产管理计划	40,000,000.00	2.11%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

注：本报告期末，本基金基金管理人的从业人员（包括本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理）未持有本基金。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本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：本基金管理人本报告期内未发生重大人事变动。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的基金托管部门本报告期内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

本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

本基金本报告期内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

本报告期内，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 81,000.00 元。自本基金基金合同生效以来，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稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员本报告期内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	
光大证券股份有限公司	1	81,951,446.74	54.41%	69,206.04	53.99%	-
招商证券股份有限公司	1	68,669,935.11	45.59%	58,978.45	46.01%	-

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
光大证券股份有限公司	254,583,034.37	5.28%	6,281,000,000.00	3.58%	-	-
招商证券股份有限公司	4,563,994,977.47	94.72%	169,261,800,000.00	96.42%	-	-

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

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	交银施罗德信用添利债券证券投资基金 2011 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-1-20
2	交银施罗德信用添利债券证券投资基金（更新）招募说明书摘要（2012 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-3-12
3	交银施罗德信用添利债券证券投资基金 2011 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-3-30
4	交银施罗德信用添利债券证券投资基金 2012 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-4-23
5	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德信用添利债券证券投资基金第一次分红公	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-6-20

	告		
6	交银施罗德信用添利债券证券投资基金 2012 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-18
7	交银施罗德信用添利债券证券投资基金 2012 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-8-28
8	交银施罗德信用添利债券证券投资基金（更新）招募说明书摘要（2012 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-9-10
9	交银施罗德信用添利债券证券投资基金 2012 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-10-26

§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信用添利债券证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、关于申请募集交银施罗德信用添利债券证券投资基金之法律意见书；
- 8、报告期内交银施罗德信用添利债券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
二〇一三年三月二十八日