

交银施罗德信用添利债券证券投资基金
2012 年年度报告摘要
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

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 2012 年 1 月 1 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	$80\% \times \text{中债企业债总全价指数收益率} + 20\% \times \text{中债国债总全价指数收益率}$
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

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	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

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。

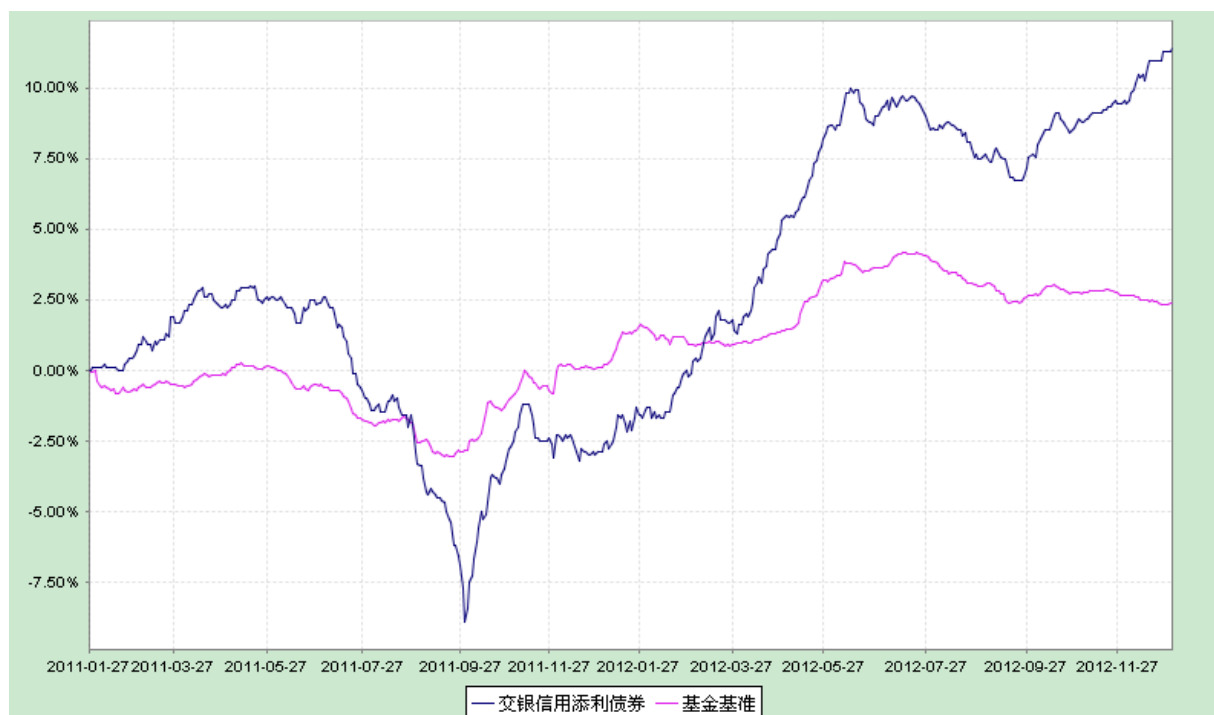
3.2 基金净值表现

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

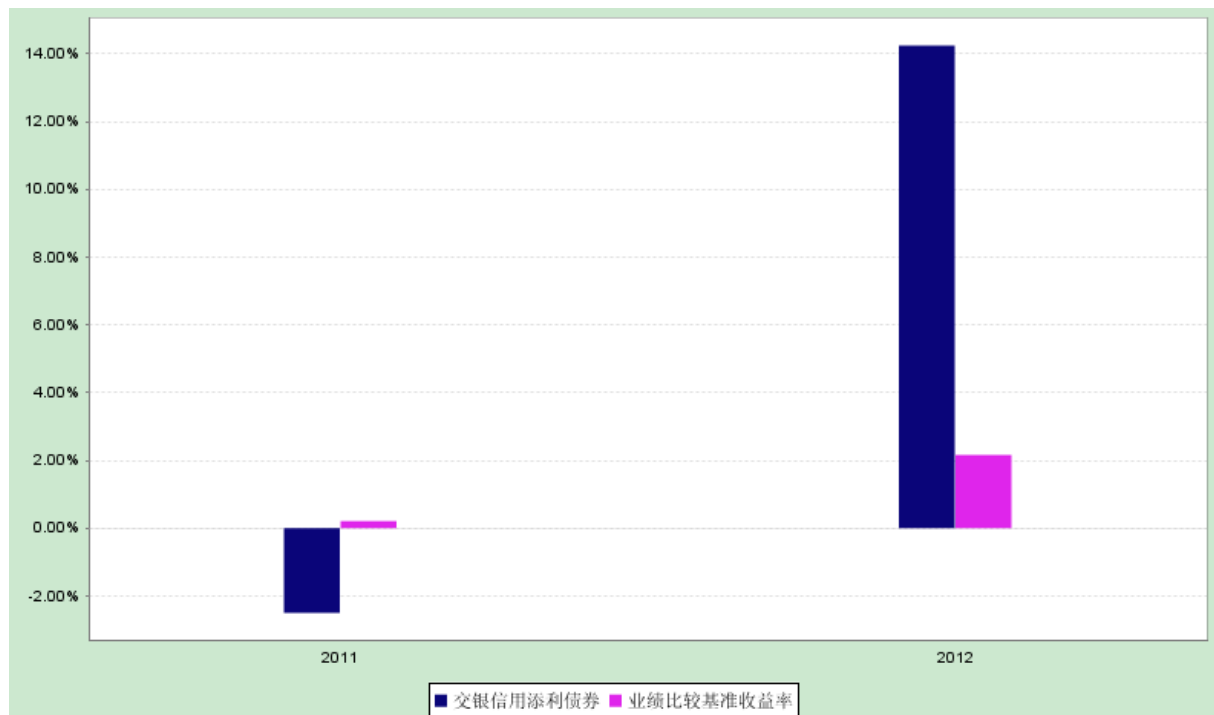
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	3.45%	0.13%	-0.26%	0.04%	3.71%	0.09%
过去六个月	2.18%	0.15%	-1.22%	0.05%	3.40%	0.10%
过去一年	14.24%	0.20%	2.16%	0.07%	12.08%	0.13%
自基金合同生效起至今	11.38%	0.24%	2.37%	0.09%	9.01%	0.15%

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
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，具体情况参见年度报告正文 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 2012 年 12 月 31 日的资产负债表，2012 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(2013)第 20242 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：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。

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：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

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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 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。

7.4.8.2 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 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。

7.4.8.2.2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。

7.4.8.2.3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

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	-	-	-	-	-	-

7.4.8.4 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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2012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

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。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 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 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

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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 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	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

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前十名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管理计划	73,050,307.00	3.85%
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。

交银施罗德基金管理有限公司
 二〇一三年三月二十八日