

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:二〇一三年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,也不保证基金份额净值不致发生较大波动。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告于2013年1月21日编制完成。

本报告自2012年10月1日起至12月31日止。

基金产品概况	
基金简称	交银成长股票
基金代码	519602
交易代码	519602(前端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月23日
报告期末基金份额总额	2,748,375,697.71份
投资目标	本基金属于成长型股票基金,主要通过投资于经过严格筛选的优质上市公司股票,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化,以及上市公司成长性、估值的基础上,通过优选成长性良好、成长具有可持续性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资,以谋求超额收益。
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数+25%×富时中国国债指数
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,具有良好成长性,属于证券投资基金中风险收益特征较高的品种。
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

主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2012年10月1日—2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-143,166,286.24
2.本期利润	457,217,328.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.1669
4.期末基金份额净值	7.191,965,534.88
5.期末基金份额净值	2.6168

注:1、上述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。

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.99%	1.09%	3.36%	1.01%	3.63%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束及本报告期末,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

交银施罗德成长股票证券投资基金

2012 第四季度报告

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:二〇一三年一月二十一日	
§ 1 重要提示	
基金管理人的董事会及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责任。	
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,也不保证基金份额净值不致发生较大波动。	
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。	
本报告于2013年1月21日编制完成。	
本报告自2012年10月1日起至12月31日止。	

基金产品概况	
基金简称	交银成长股票
基金代码	519602
交易代码	519602(前端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月23日
报告期末基金份额总额	2,748,375,697.71份
投资目标	本基金属于成长型股票基金,主要通过投资于经过严格筛选的优质上市公司股票,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化,以及上市公司成长性、估值的基础上,通过优选成长性良好、成长具有可持续性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资,以谋求超额收益。
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数+25%×富时中国国债指数
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,具有良好成长性,属于证券投资基金中风险收益特征较高的品种。
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

主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2012年10月1日—2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-143,166,286.24
2.本期利润	457,217,328.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.1669
4.期末基金份额净值	7.191,965,534.88
5.期末基金份额净值	2.6168

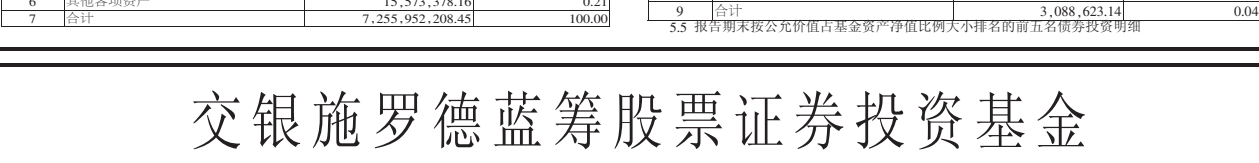
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。

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。

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.99%	1.09%	3.36%	1.01%	3.63%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束及本报告期末,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	18,920	1,822,942.00	0.03
2	125887	中债转债	12,376	1,265,681.14	0.02

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,738,881.44
2	应收证券清算款	374,934.57
3	应收股利	-
4	应收利息	183,807.66
5	应收申购款	12,025,754.55
6	其他应收款	250,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,573,378.16

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	1,822,942.00	0.03
2	125887	中债转债	1,265,681.14	0.02

5.8.5 报告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。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、交银施罗德基金管理有限公司期末持有本基金份额23,897,493.58份,占本基金期末总份额的0.87%。

2、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。

§ 6 开放式基金份额变动

项目	交银增利债券A/B	交银增利债券C
本报告期期初基金份额总额	2,659,470,607.97	473,545,294.34
本报告期基金总申购份额	384,660,000.00	384,660,000.00
本报告期基金总赎回份额	384,660,000.00	384,660,000.00
本报告期基金净申购份额	2,748,375,697.71	2,748,375,697.71

注:1、如果本报告期间发生转入转出、红利再投资,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换业务,则总赎回份额中包含该业务。

§ 7 备查文件目录

1. 中国证监会批准交银施罗德成长股票证券投资基金募集的文件;
 2. 交银施罗德成长股票证券投资基金基金合同;
 3. 交银施罗德成长股票证券投资基金招募说明书;
 4. 交银施罗德成长股票证券投资基金托管协议;
 5. 关于募集交银施罗德成长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准、营业执照;
 7. 基金托管人业务资格批准、营业执照;
 8. 报告期内交银施罗德成长股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。
- 7.2 存放地点
- 备查文件存放于基金管理人的办公场所。
- 7.3 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或www.jsfund.com或www.bocomschneider.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印件或复印件。
- 投资者对本报告如有任何疑问,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)、021-60150500,电子邮件:service@jyfund.com。

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:二〇一三年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,也不保证基金份额净值不致发生较大波动。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告于2013年1月21日编制完成。

本报告自2012年10月1日起至12月31日止。

基金产品概况	
基金简称	交银蓝筹股票
基金代码	519604
交易代码	519604(前端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月8日
报告期末基金份额总额	11,765,102,052.13份
投资目标	本基金是一只股票型基金,主要通过投资于业绩优良、发展稳定、在行业内具有支配性地位、分红稳定的蓝筹上市公司股票,追求基金资产的长期增值。
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,通过优选成长性良好、成长具有可持续性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资,以谋求超额收益。
业绩比较基准	75%×中证100指数+25%×中证国债指数
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,具有良好成长性,属于证券投资基金中风险收益特征较高的品种。
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

主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2012年10月1日—2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-280,291,558.91
2.本期利润	474,170,641.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0400
4.期末基金份额净值	8,372,158,313.20
5.期末基金份额净值	0.7116

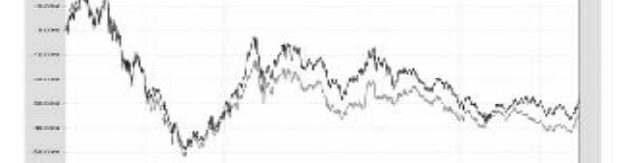
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。

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。

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.02%	0.97%	9.65%	0.95%	-3.63%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束及本报告期末,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

交银施罗德蓝筹股票证券投资基金

2012 第四季度报告

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:二〇一三年一月二十一日	
§ 1 重要提示	
基金管理人的董事会及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责任。	
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,也不保证基金份额净值不致发生较大波动。	
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。	
本报告于2013年1月21日编制完成。	
本报告自2012年10月1日起至12月31日止。	

基金产品概况	
基金简称	交银蓝筹股票
基金代码	519604
交易代码	519604(前端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月8日
报告期末基金份额总额	11,765,102,052.13份
投资目标	本基金是一只股票型基金,主要通过投资于业绩优良、发展稳定、在行业内具有支配性地位、分红稳定的蓝筹上市公司股票,追求基金资产的长期增值。
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,通过优选成长性良好、成长具有可持续性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资,以谋求超额收益。
业绩比较基准	75%×中证100指数+25%×中证国债指数
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,具有良好成长性,属于证券投资基金中风险收益特征较高的品种。
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

主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2012年10月1日—2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-280,291,558.91
2.本期利润	474,170,641.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0400
4.期末基金份额净值	8,372,158,313.20
5.期末基金份额净值	0.7116

注:1、上述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。

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.02%	0.97%	9.65%	0.95%	-3.63%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束及本报告期末,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	274,700	26,467,345.00	0.32
2	081601	08浦发债	200,000	20,060,000.00	0.24
3	125887	中债转债	29,962	3,064,183.78	0.04

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,797,328.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,603,656.09
5	应收申购款	4,920,623.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,321,608.47

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	26,467,345.00	0.32
2	125887	中债转债	3,064,183.78	0.04

5.8.5 报告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。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、交银施罗德基金管理有限公司期末持有本基金份额19,034,797.82份,占本基金期末总份额的0.16%。

2、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。

§ 6 开放式基金份额变动

项目	交银增利债券A/B	交银增利债券C
本报告期期初基金份额总额	11,927,739,649.26	35,985,762.49
本报告期基金总申购份额	198,623,599.62	198,623,599.62
本报告期基金总赎回份额	11,765,102,052.13	11,765,102,052.13

注:1、如果本报告期间发生转入转出、红利再投资,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换业务,则总赎回份额中包含该业务。

§ 7 备查文件目录

1. 中国证监会批准交银施罗德蓝筹股票证券投资基金募集的文件;
 2. 交银施罗德蓝筹股票证券投资基金基金合同;
 3. 交银施罗德蓝筹股票证券投资基金招募说明书;
 4. 交银施罗德蓝筹股票证券投资基金托管协议;
 5. 关于募集交银施罗德蓝筹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准、营业执照;
 7. 基金托管人业务资格批准、营业执照;
 8. 报告期内交银施罗德蓝筹股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。
- 7.2 存放地点
- 备查文件存放于基金管理人的办公场所。
- 7.3 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或www.jsfund.com或www.bocomschneider.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印件或复印件。
- 投资者对本报告如有任何疑问,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)、021-60150500,电子邮件:service@jyfund.com。

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:二〇一三年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,也不保证基金份额净值不致发生较大波动。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告于2013年1月21日编制完成。

本报告自2012年10月1日起至12月31日止。

基金产品概况	
基金简称	交银增利债券
基金代码	519680
交易代码	519680(前端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年3月31日
报告期末基金份额总额	1,849,113,088.62份
投资目标	本基金属于固定收益类基金,主要通过投资于具有良好流动性、低风险、高信用等级的债券,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金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,动态调整大类资产配置比例,自上而下决定投资组合久期,中期期限配置及债券类别配置,自下而上地配置债券品种和个券。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
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低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金。
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

主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2012年10月1日—2012年12月31日)
1.本期已实现收益	21,779,863.00
2.本期利润	6,449,403.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0036
4.期末基金份额净值	1.451,204,456.34
5.期末基金份额净值	1.0273

注:1、上述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