

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：二〇一〇年一月二十一日

**重要提示**  
基金管理人的董事会及监事会在审议本基金报告时不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质内容、准确性、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2010年1月20日复核了本报告中的财务数据、净值表现和资产组合报告等内容，确认本基金不存在虚假记载、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。

本报告期自2009年10月1日起至12月31日止。

**§ 2 基金产品概况**

基金全称：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

基金代码：510010

基金运作方式：交易型开放式

基金合同生效日：2009年1月25日

报告期末基金资产总额：7,736,452,362.97

投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差与跟踪误差最小化。

投资策略：本基金通过在股票市场上根据标的指数成份股及其权重的变动情况，进行被动的指数化投资，以完全复制和追踪标的指数的表现为目标，通过被动式指数化投资，股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动情况而相应调整，从而使得基金净值增长率与标的指数收益率之间的差额控制在一定的范围内，基金净值增长率与标的指数收益率之间的差额控制在0.5%以内。

业绩比较基准：上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金净值。

风险收益特征：本基金为股票基金，预期收益较高，风险系数较大的品种。

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

注：本表所列的基金代码510010为本基金第一级市场交易代码，本基金二级市场申购赎回代码为510011。

**§ 3 主要财务指标和基金净值表现**

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2009年10月1日-2009年12月31日)

1.本期已实现收益 8,395,557.61

2.本期利润 178,903,226.76

3.加权平均基金份额本期利润 0.1397

4.期末基金资产净值 7,065,438,428.40

5.期末基金份额净值 0.913

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.61% 1.66% 16.71% -15.10% -0.43%

基金额度发生以来至今 1.61% 1.31% 14.34% -12.63% -0.48%

5.3.2 基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

5.3.2 基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4. 自基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准 收益率差为%

过去三个月 1.50% 1.26% 15.87% 1.70% -14.37% -0.44%

基金额度发生以来至今 1.50% 1.23% 17.55% 1.68% -16.05% -0.45%

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未经费用调整的计算结果；  
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. 基金净值的表现

4.