

DISCLOSURE

信息披露

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

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告期内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、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设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指标、净值表现、净值增长率、偏离度等內容，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。

本报告期中财务资料未经审计。

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

基金名称:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金

基金代碼:519694

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

基金合同生效日:2007年7月8日

报告期末基金份额总额:15,429,177,711.48份

基金类型:股票型基金

基金运作方式:开放式基金

上市交易场所:上海证券交易所

基金合同约定的投资范围:本基金主要投资于股票，股票资产占基金资产的比例不低于基金资产的80%，并主要投资于具有稳定分红能力的上市公司股票，以追求资本的长期稳定增长。

基金合同约定的投资策略:本基金在充分分析基金管理人的研究实力、行业配置、规模配置的选股方法与积极主动的管理风格的基础上，精选质地优良、估值合理的股票进行投资，以求获得资本的长期稳定增长。

业绩比较基准:75%×上证综合指数+25%×中证金融债指数

风险收益特征:本基金是一只股票型基金，以追求稳定的较高收益为主要投资对象，属于证券投资基金中的高风险、高收益品种。

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

基金合同生效日:2007年7月8日

报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2009年10月1日起至12月31日止。

§ 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 769,932,147.02

2.期初累计净值 2,171,107,530.23

3.本期利润 1,500,750,153.51

4.期末基金净值 14,494,554,943.83

5.期末基金份额净值 0.9274

注:1.上述基金业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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) **(1-③)** **(2-④)**

过去三个月 16.74% 1.51% 12.78% 1.31% 3.96% 0.29%

过去一年 -5.97% 1.78% -16.00% 1.88% -10.03% -0.10%

3.2.2本报告期向后以来以基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

交银施罗德蓝筹股票证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2007年7月8日至2009年12月31日)

5.1 报告期末基金份额组合情况

5.2 报告期未按行业分类的股票投资组合

5.3 报告期未按债券品种分类的债券投资组合

5.4 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.5 报告期未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

交银施罗德蓝筹股票证券投资基金

2009 第 四 季 度 报 告

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2009年12月31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 基金经理(或基金经理助理)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
崔海峰	本基金的基金经理 公司权益部 总经理助理	2008-9-1	-	崔海峰先生,中国国籍,经济学硕士,历任国泰基金管理有限公司研究员,基金经理助理,基金经理,基金经理助理,国泰基金管理有限公司,2008年加入交银施罗德基金管理有限公司。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《交银施罗德蓝筹股票证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关规定进行运作,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

本公司严格实行公平交易制度,公平对待旗下所有投资组合,本投资组合与公司旗下管理的其他投资组合的整体收益分配、不同类别资产的配置以及不同时间窗内(同日内、10日内)同时期内的交易行为均是公平的。

4.4 投资组合附注

本基金主要投资于股票,以挑选质地优良、估值合理的股票进行投资,以求获得资本的长期稳定增长。

4.5 其他需要说明的事项

本基金的运作符合基金合同的有关约定。

4.6 报告期内基金的业绩表现

截至2009年12月31日,本基金份额净值为0.9274元,本报告份额净值增长率为16.74%,同期业绩比较基准增长率为12.78%。

5. 投资组合报告

5.1 报告期末基金份额组合情况

5.2 报告期未按行业分类的股票投资组合

5.3 报告期未按债券品种分类的债券投资组合

5.4 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.5 报告期未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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	13,130,372,583.04	90.02	-
1.1	其中:股票	13,130,372,583.04	90.02	-
2	固定收益投资	774,406,000.00	5.31	-
2.1	其中:债券	774,406,000.00	5.31	-
3	货币市场工具	-	-	-
4	买入返售金融资产	-	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	647,750,877.61	4.44	-
6	其他资产	34,210,296.02	0.23	-
7	合计	14,586,739,756.67	100.00	-

序号	债券品种	券面金额(元)	数量(张)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	733,924,000.00	1.17	-
2	央行票据	20,638,000.00	0.14	-
3	金融债券	19,844,000.00	0.14	-
4	企业债券	-	-	-
5	公司短期融资券	-	-	-
6	可转债	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	774,406,000.00	100.00	-

5.5 报告期未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

本基金本报告期末未持有债券投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.6 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.7 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.8 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.9 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.10 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.11 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.12 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.13 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.14 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.15 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.16 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.17 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细

5.18 投资组合附注

本基金本报告期末未持有货币市场工具投资证券投资基金明细