交银施罗德增利债券证券投资基金2008年年度报告

2008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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2009年03月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）根据本基金合同规定，于 2009 年 3 月 25 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 2008 年 3 月 31 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
§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 5
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 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
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 16
§6 审计报告 16
§7 年度财务报表 17
7.1 资产负债表 17
7.2 利润表 19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 20
7.4 报表附注 21
§8 投资组合报告 40
8.1 期末基金资产组合情况 40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 41
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 42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 44
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 44
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 45
8.8 本基金本报告期末未持有权证 45
8.9 投资组合报告附注 45
§9 基金份额持有人信息 46
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 46
§10 开放式基金份额变动 46
§11 重大事件揭示 47
§12 影响投资者决策的其他重要信息目录 53

§13 备查文件目录 53
13.1 备查文件目录 53
13.2 存放地点 54
13.3 查阅方式 54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德增利债券证券投资基金	
基金简称	交银增利	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年03月31日	
报告期末基金份额总额	10,622,651,700.53	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	交银增利A/B	交银增利C
下属两级基金的交易代码	A类519680，B类519681	C类519682
报告期末下属两级基金的份额总额	6,410,744,715.53	4,211,906,985.00

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，自下而上个券选配，在控制信用风险、利率风险、流动性风险前提下，主要通过投资承担一定信用风险、具有较高息票率的债券，实现基金资产的长期稳定增长。
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，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置，自下而上地配置债券类属和精选个券。
业绩比较基准	中债企业债总指数
风险收益特征	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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	陈超	尹东

负责人	联系电话	021-61055050	010-67595003
	电子邮箱	xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com	yindong@ccb.cn
客户服务电话		400-700-5000，021-61055000	010-67595096
传真		021-61055034	010-66275853
注册地址		上海市交通银行大楼二层（裙）	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100140
法定代表人		彭纯	郭树清

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.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	会计师事务所	注册登记机构
名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
办公地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼	北京西城区金融大街27号投资广场23层

§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	2008年3月31日至2008年12月31日	
	A/B类	C类
本期已实现收益	469,089,804.41	238,303,899.06

本期利润	923,978,549.20	422,931,834.38
加权平均基金份额本期利润	0.1290	0.1373
本期加权平均净值利润率	12.42%	13.13%
本期基金份额净值增长率	13.04%	12.66%
3.1.2 期末数据和指标	2008年3月31日至2008年12月31日	
期末可供分配利润	219,195,722.86	129,132,594.98
期末可供分配基金份额利润	0.0342	0.0307
期末基金资产净值	7,051,508,912.36	4,617,256,446.22
期末基金份额净值	1.1000	1.0962
3.1.3 累计期末指标	2008年3月31日至2008年12月31日	
基金份额累计净值增长率	13.04%	12.66%

注：1、本基金基金合同生效日为2008年3月31日，基金合同生效日至本报告期期末，本基金运作时间未满一年。

2、本基金A/B类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。

3、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。

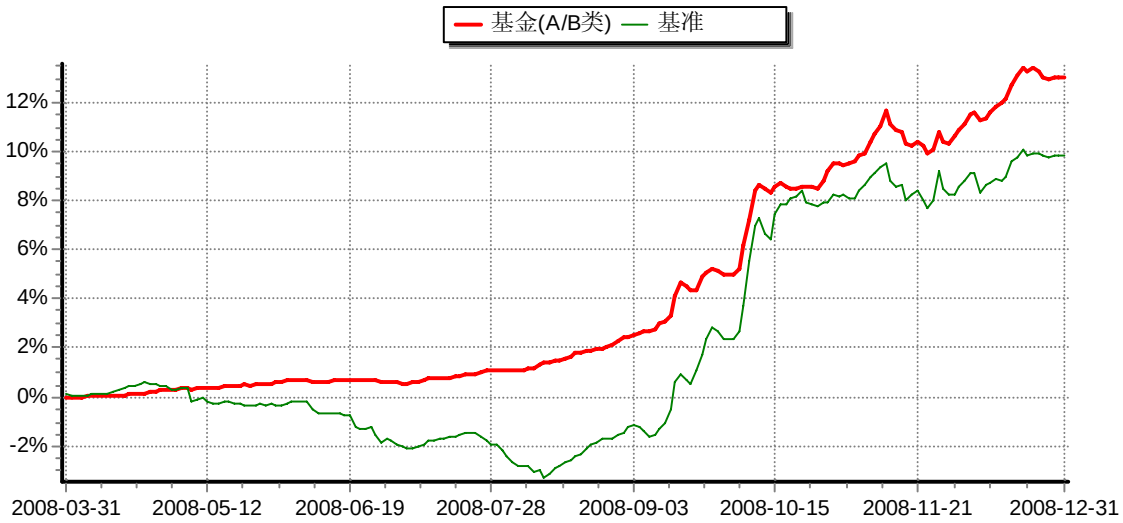
3.2 基金净值表现

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

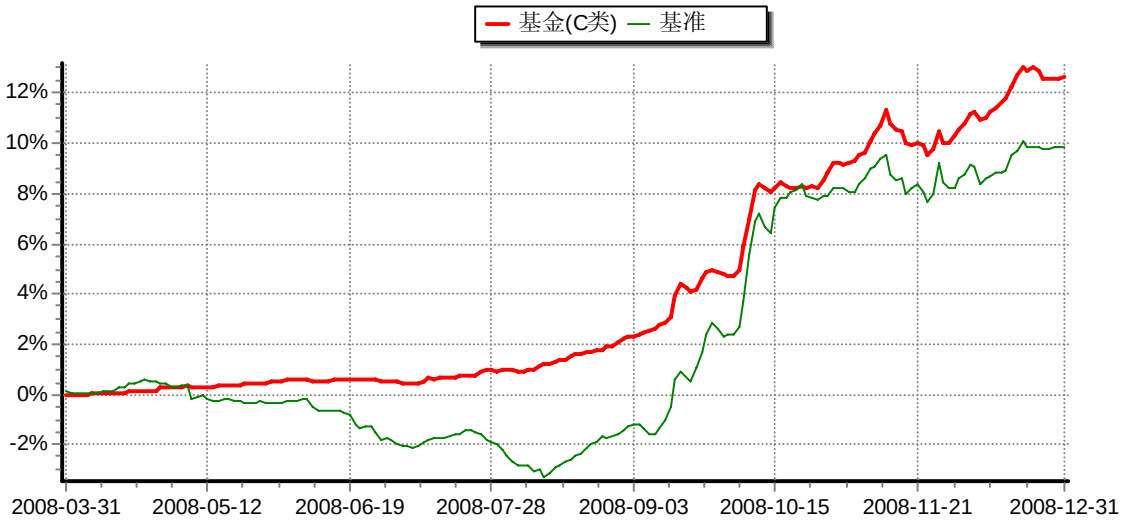
类别	阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
A/B类	过去三个月	7.68%	0.30%	7.29%	0.43%	0.39%	-0.13%
	过去六个月	12.34%	0.23%	11.76%	0.35%	0.58%	-0.12%
	自基金合同生效日起至今（2008年03月31日-2008年12月31日）	13.04%	0.20%	9.84%	0.30%	3.20%	-0.10%

C类	过去三个月	7.55%	0.30%	7.29%	0.43%	0.26%	-0.13%
	过去六个月	12.07%	0.23%	11.76%	0.35%	0.31%	-0.12%
	自基金合同生效日起至今（2008年03月31日-2008年12月31日）	12.66%	0.20%	9.84%	0.30%	2.82%	-0.10%

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

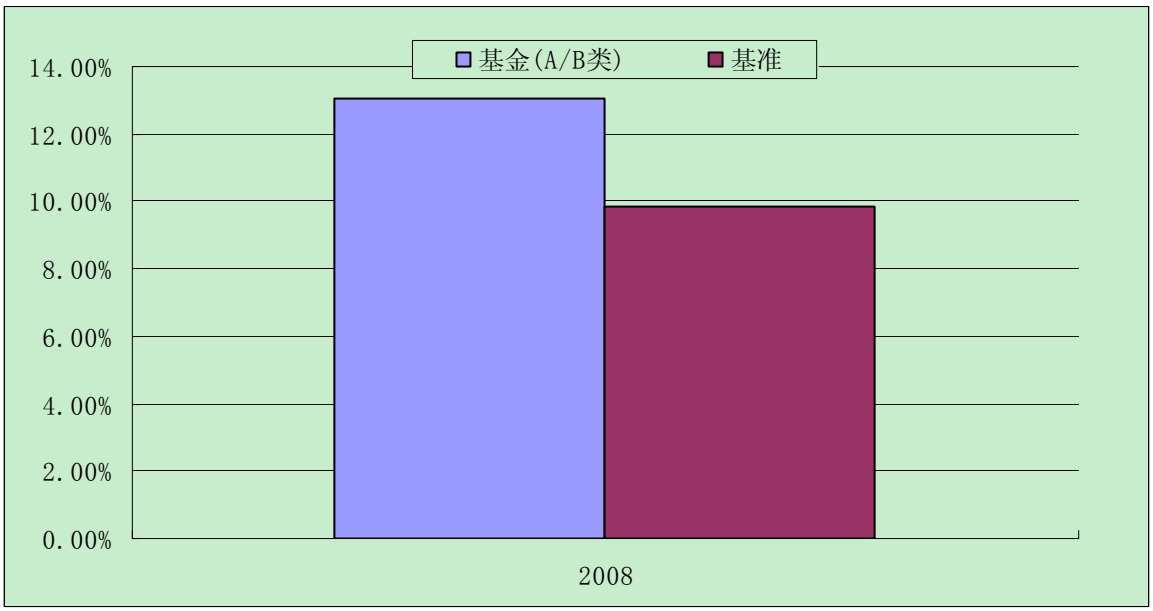


注：本基金基金合同生效日为2008年3月31日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2008年3月31日至2008年12月31日。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2008年12月31日，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

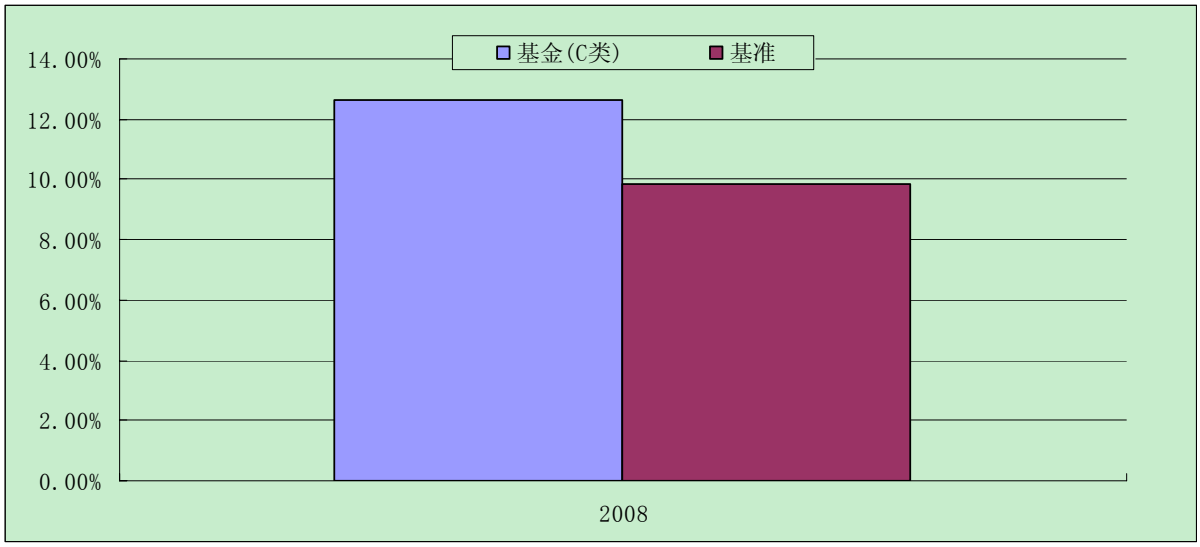


注：本基金基金合同生效日为2008年3月31日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2008年3月31日至2008年12月31日。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2008年12月31日，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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2008年3月31日至2008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。



注：图示日期为2008年3月31日至2008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
2008年	0.300	286,389,899.65	118,915,832.63	405,305,732.28	-
合计	0.300	286,389,899.65	118,915,832.63	405,305,732.28	-

§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金字[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2008年12月31日，公司已经发行并管理的的基金共有七只，均为开放式基金：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）和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）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈晓秋	本基金的基金经理，交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理	2008年03月31日	—	6年	陈晓秋女士，经济学硕士。曾任富国基金管理有限公司研究策略部和投资部研究员，负责债券及宏观分析、债券投资。2005年加入交银施罗德基金管理有限公司。
李家春	本基金的基金经理，交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理	2008年03月31日	—	9年	李家春先生，经济学学士。历任长江证券有限责任公司投资经理，汉唐证券有限责任公司高级经理、投资主管，泰信基金管理有限公司高级研究员。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司。

注：1、本表所列基金经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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、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、安全高效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 公平交易制度的执行情况

本公司有严格的投资控制制度和风险监控制度来保证旗下基金运作的公平，报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。所管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率以及不同时间窗内（同日内、5日内、10日内）同向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本投资组合成立至今未满一年。在本报告期内无完整的年度收益率数据，与其他投资风格相似的投资组合的年度业绩不具备可比性。在分季度的收益率比较中，未出现与其他投资风格相似的组合之间的业绩表现差异超过5%的情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2008年中国经济和债券市场都经历了巨大的变化。中国经济从年初的高通货膨胀演变至年底物价水平出现月度负增长，大宗商品价格在第四季度暴跌，生产者价格指数从7月份的10%迅速跌至11月份的2%；工业生产逐月放缓，在第四季度甚至出现个位数的增长。相应的，中国的宏观经济政策取向也迅速转变：2008年上半年，中国人民银行继续执行偏紧的货币政策，将商业银行存款准备金率从14.5%逐步提高至17.5%。但随着中国经济增长明显放缓和国际经济金融形势的不断恶化，人民银行在9月中旬就宣布降低贷款利率和准备金率，并且在接下来的3个月内，4次降息，3次调低准备金率，幅度之大速度之快超乎市场预期。

随着通货膨胀压力的缓解以及货币政策的转变，债券市场从9月份开始迅速上涨，中债全债指数在4个月内的累计涨幅达到10%，上升的速度和幅度都明显超过以往的债券市场牛市。受无风险收益率迅速下降的支撑，信用债券市场也出现了大幅的上涨。但是，在宏观经济金融环境的不断恶化的情况下，部分行业及企业逐渐显现出资金链紧张、利

润下滑、经营环境恶化的状况，引发了10月中旬信用债券市场大幅调整，打破了中国债券市场中的信用债券只是收益率略高的“无违约风险”债券的历史，逐渐演变成一个多种信用等级工具并存的债券市场。从这种意义上说，中国的信用债市场发展进入了一个新的阶段，高收益信用债将作为一个单独的资产类别进入投资者的视野和组合。

回顾交银增利基金2008年的投资操作，整体投资策略大致符合市场实际运行情况。在成立之初主要买入3年期央行票据，保持组合适当的久期和高度的流动性；9月初，在判断通货膨胀压力已经明显减轻后迅速拉长组合久期，获得了较高的收益。在大类资产配置方面，由于预期经济增长以及企业利润将会逐渐恶化、权益类资产表现不佳，基金管理组在2008年始终保持极低的权益类资产比例。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从2008年下半年开始，中国经济经历了大幅调整，企业减产以消化原先积累的过高的库存，因此10、11月份工业增加值增长迅速放缓，降至个位数；物价水平从高位迅速滑落，尤其是原材料和工业品的价格。我们认为，随着企业消减过高库存的进程逐渐结束，08年下半年以来经济快速下滑的态势将会有所改善，2009年下半年经济有可能逐渐走稳。为了实现经济复苏，宏观政策将会继续保持刺激的取向，包括积极的财政政策和宽松的货币政策。

2009年，由于货币政策会在相当一段时间内保持宽松的政策取向，包括下调存贷款基金利率和准备金率等措施，因此债券市场还会受到一定的支撑，维持上涨的态势。但是，债券市场在经历了2008年大幅上涨的走势后，整体收益率已经降至较低的绝对水平，收益率继续下降的空间相对较小。如果2009年下半年经济逐渐走稳后，货币政策和财政政策的刺激效果将不断积累，促使投资者开始考虑债券收益率过低的投资风险，因而债券市场的波动可能会加大。同时，随着经济走稳，投资者对未来经济增长的悲观预期可能会发生变化，权益类资产可能会出现一定的投资机会。

2009年交银增利基金将密切关注宏观经济形势及经济政策的变化，及时地调整大类资产配置和组合久期策略。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2008年度，本基金管理人根据《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：

1、修订完善内部管理制度体系

2008年公司进一步修订完善内部管理制度体系，将公司现有制度分成内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章、操作流程、业务手册等五个层次，组织对公司内部

控制大纲和基本管理制度进行修订更新，并由各业务部门对部门制度进行检查和修订，形成更为完整的公司管理制度和流程体系。

2、完善投资研究管理流程体系

2008年，配合公司基金管理规模扩大、基金品种增加，以及开展专户理财业务的需要，公司重点进行了投资研究业务流程的完善，以加强投资流程的规范性，防范投资风险。投资研究部相继制定或修订相关投资管理办法及内部审批流程，使公司投资研究的业务流程更为明确规范，也使基金投资的内部控制更有效。

3、加强基金销售内部控制

2008年公司对基金销售的系统、流程、内部控制进行了进一步的完善，根据证监会新发布的《证券投资基金销售业务信息管理平台管理规定》、《证券投资基金销售适用性指导意见》、《证券投资基金销售机构内部控制指导意见》等规定积极进行自查并落实各项监管要求。

4、做好新业务内控准备

公司在2008年积极拓展新业务，为确保新业务、新产品的顺利运作，公司对相关配套的内部制度和流程在业务开展前就进行了较为充分的准备，做好风险控制体系的设计和全面风险评估以寻找风险来源，针对风险实施有效控制，确保公司新业务能有序开展，规范运作。

5、加强合规教育

2008年公司开展了多种形式的合规教育：公司更新了内部合规制度，组织相关专题培训，促进上述制度在公司内部得到落实；公司并根据《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》、《证券投资基金销售机构内部控制指导意见》对投资管理人员、基金销售人员合规培训的要求，邀请公司法律顾问为员工进行多次专题合规培训，以加强公司基金从业人员对法规的认识，提升合规意识。

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、风险控制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，由金融工程部进行测算和认证，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照法律法规及基金合同的约定，本报告期内交银增利A/B类、C类利润分配信息列示如下：

份额级别	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
A/B 类	422,999,205.60	250,803,394.47	172,195,811.13	一次
C 类	255,271,439.51	154,502,337.81	100,769,101.70	一次
合计	678,270,645.11	405,305,732.28	272,964,912.83	

本基金于2009年2月27日进行第二次分红，向A/B类基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.41元，向C类基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.36元。本次分红的权益登记日、除息日：2009年2月27日，红利再投确认日：2009年3月2日，现金红利划出日：2009年3月3日。交银增利A/B类此次分配金额为 190,972,727.86元，交银增利C类此次分配金额为：110,510,578.19元。此次分红之后，2008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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了认真的复核，对本

基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2009)第 20246 号

交银施罗德增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增利债券证券投资基金 (以下简称“交银施罗德增利债券基金”)的财务报表，包括 2008 年 12 月 31 日的资产负债表、2008 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2008 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是交银施罗德增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) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
(2) 选择和运用恰当的会计政策；
(3) 作出合理的会计估计。

二、 注册会计师的责任

我们的责任是在实施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职业道德规范，计划和实施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，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，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，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了交银施罗德增利债券基金2008年12月31日的财务状况以及2008年3月31日(基金合同生效日)至2008年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天　　注册会计师　　薛　　竞
会计师事务所有限公司

中国　上海市　　注册会计师　　金　　毅
2009 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德增利债券证券投资基金
报告截止日：2008年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2008年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	905,354,225.53
结算备付金		18,242,783.42
存出保证金		13,230.50
交易性金融资产	7.4.7.2	13,428,585,029.15
其中：股票投资		556,155.00

债券投资		13,228,284,694.50
资产支持证券投资		199,744,179.65
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		2,006,313.65
应收利息	7.4.7.5	212,571,803.35
应收股利		-
应收申购款		32,977,139.60
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		14,599,750,525.20
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2008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		2,882,996,520.50
应付证券清算款		-
应付赎回款		36,239,109.87
应付管理人报酬		6,205,126.20
应付托管费		2,068,375.41
应付销售服务费		1,624,040.73
应付交易费用	7.4.7.7	94,462.69
应交税费		1,035,847.11
应付利息		308,417.05
应付利润		-
其他负债	7.4.7.8	413,267.06
负债合计		2,930,985,166.62
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	10,622,651,700.53
未分配利润	7.4.7.10	1,046,113,658.05

所有者权益合计		11,668,765,358.58
负债和所有者权益总计		14,599,750,525.20

注：1、本期财务报表的实际编制期间为2008年3月31日(基金合同生效日)至2008年12月31日。

2、报告截止日2008年12月31日，基金份额总额10,622,651,700.53 份，其中A/B类基金份额6,410,744,715.53份；C类基金份额4,211,906,985.00份；A/B类基金份额净值1.1000元；C类基金份额净值1.0962元。

7.2 利润表

会计主体：交银施罗德增利债券证券投资基金

本报告期：2008年3月31日至2008年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2008年3月31日至2008年12月31日
一、收入		1,449,631,840.31
1.利息收入		348,608,950.92
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,059,318.83
债券利息收入		335,371,115.15
资产支持证券利息收入		5,658,038.05
买入返售金融资产收入		520,478.89
其他利息收入		-
2.投资收益		459,481,984.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	31,966,915.21
债券投资收益	7.4.7.13	422,904,958.93
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	473,280.00
衍生工具收益	7.4.7.15	4,136,830.02
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益	7.4.7.17	639,516,680.11
4.其他收入	7.4.7.18	2,024,225.12
二、费用		-102,721,456.73
1. 管理人报酬		-48,030,112.97
2. 托管费		-16,010,037.70

3．销售服务费		-9,668,258.01
4．交易费用	7.4.7.19	-508,659.48
5．利息支出		-28,040,070.61
其中：卖出回购金融资产支出		-28,040,070.61
6．其他费用	7.4.7.20	-464,317.96
三、利润总额		1,346,910,383.58
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,346,910,383.58

注：本期财务报表的实际编制期间为2008年3月31日(基金合同生效日)至2008年12月31日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德增利债券证券投资基金

本报告期：2008年3月31日至2008年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2008年3月31日至2008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）	10,322,807,118.45	—	10,322,807,118.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	1,346,910,383.58	1,346,910,383.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	299,844,582.08	104,509,006.75	404,353,588.83
其中：1.基金申购款	17,261,991,250.35	1,035,576,048.08	18,297,567,298.43
2.基金赎回款	-16,962,146,668.27	-931,067,041.33	-17,893,213,709.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	—	-405,305,732.28	-405,305,732.28
五、期末所有者权益（基金净值）	10,622,651,700.53	1,046,113,658.05	11,668,765,358.58

注：本期财务报表的实际编制期间为2008年3月31日(基金合同生效日)至2008年12月31日。

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

交银施罗德增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”)证监基金字[2008]第239号《关于核准交银施罗德增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《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币10,315,946,853.63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(2008)第029号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》于2008年3月31日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,322,807,118.45份基金份额，其中认购资金利息折合6,860,264.82份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》和《交银施罗德增利债券证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端认购申购费用的，称为A类；在投资者赎回时收取后端认购申购费用的，称为B类；不收取申购、赎回费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类。本基金A类、B类、C类三种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德增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，包括国内依法发行上市的债券、股票、权证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，其中股票投资仅限于参与新股认购和可转债转股获得的股票，权证投资仅限于参与可分离转债申购而获得的权证，即本基金不从二级市场购买股票或权证。本基金的投资组合比例为：固定收益类资产(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、次级债、可转换债券等)占基金资产的比例为80%-100%，其中次级债、资产支持证券(含资产收益计划)和可转换债券占基金资产的比例为0-40%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%；股票、权证等资产占基金资产的比例为0-20%，其中权证资产占基金资产净值的比例为0-3%。本基金的业绩比较基准为：中债企业债总指数。

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2009年3月24

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”)、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《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>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2008年3月31日(基金合同生效日)至2008年12月31日止期间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2008年12月31日的财务状况以及2008年3月31日(基金合同生效日)至2008年12月31日止期间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

2008年本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2008年3月31日(基金合同生效日)至2008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

(i) 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。本基金目前暂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。

(ii) 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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的或资产支持证券利息，应当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。

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，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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

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、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(i)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。

(ii)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。

(iii)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。当本基金依法有权抵销债权债务且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

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率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按证券票面价值与预计收益率计算并确认利息收入，对于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；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也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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也可按直线法计算。

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。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。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其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.4.12.1计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局/财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 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。

(b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c) 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派发利息时代扣代

缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。

(d) 基金买卖股票于2008年4月24日之前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税，自2008年4月24日起至2008年9月18日止按0.1%的税率缴纳。自2008年9月19日起基金卖出股票按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:2008年12月31日
活期存款	905,354,225.53
定期存款	-
其他存款	-
合计	905,354,225.53

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末:2008年12月31日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		556,155.00	556,155.00	-
债券	交易所市场	1,241,844,022.84	1,322,628,194.50	80,784,171.66
	银行间市场	11,347,237,378.14	11,905,656,500.00	558,419,121.86
	合计	12,589,081,400.98	13,228,284,694.50	639,203,293.52
资产支持证券		199,430,793.06	199,744,179.65	313,386.59
其他		-	-	-
合计		12,789,068,349.04	13,428,585,029.15	639,516,680.11

注：债券投资中银行间同业市场交易的债券和资产支持证券均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公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券和资产支持证券于本会计期间利润表中确认的公允价值变动收益为558,732,508.45元。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金无衍生金融资产及负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本报告期末本基金无买入返售金融资产余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末:2008年12月31日
应收活期存款利息	124,230.21
应收结算备付金利息	9,273.73
应收债券利息	210,333,317.90
应收申购款利息	3,266.83
其他	2,101,714.68
合计	212,571,803.35

7.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末:2008年12月31日
交易所市场应付交易费用	17,624.45
银行间市场应付交易费用	76,838.24
合计	94,462.69

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末:2008年12月31日
应付赎回费	12,155.71
应付后端申购费	21,111.35
预提费用	380,000.00
合计	413,267.06

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目(A/B类)	本期 2008年3月31日至2008年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	7,419,837,721.23	7,419,837,721.23
本期申购	6,676,485,949.11	6,676,485,949.11
本期赎回	-7,685,578,954.81	-7,685,578,954.81
本期末	6,410,744,715.53	6,410,744,715.53
项目(C类)	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,902,969,397.22	2,902,969,397.22
本期申购	10,585,505,301.24	10,585,505,301.24
本期赎回	-9,276,567,713.46	-9,276,567,713.46
本期末	4,211,906,985.00	4,211,906,985.00

注：1、本基金自2008年3月3日至2008年3月25日止期间公开发售，共募集有效净认购资金10,315,946,853.63元。根据《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入6,860,264.82元，折算为6,860,264.82份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于2008年3月31日(基金合同生效日)至2008年5月8日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自2008年5月9日起开始办理,，转换业务自2008年5月23日起开始办理。

3、本基金本期申购份额包含红利再投、转换入份额；本期赎回份额包含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目（A/B类）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	469,089,804.41	454,888,744.79	923,978,549.20
本期基金份额交易产生的变动数	909,312.92	-33,320,270.82	-32,410,957.90
其中：基金申购款	115,170,078.55	263,742,182.31	378,912,260.86
基金赎回款	-114,260,765.63	-297,062,453.13	-411,323,218.76
本期已分配利润	-250,803,394.47	-	-250,803,394.47

本期末	219,195,722.86	421,568,473.97	640,764,196.83
项目（C类）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	238,303,899.06	184,627,935.32	422,931,834.38
本期基金份额交易产生的变动数	45,331,033.73	91,588,930.92	136,919,964.65
其中：基金申购款	173,537,254.31	483,126,532.91	656,663,787.22
基金赎回款	-128,206,220.58	-391,537,601.99	-519,743,822.57
本期已分配利润	-154,502,337.81	-	-154,502,337.81
本期末	129,132,594.98	276,216,866.24	405,349,461.22

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2008年3月31日至2008年12月31日
活期存款利息收入	6,610,351.36
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	211,488.75
其他	237,478.72
合计	7,059,318.83

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2008年3月31日至2008年12月31日
卖出股票成交总额	153,356,258.13
卖出股票成本总额	-121,389,342.92
股票投资收益	31,966,915.21

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期

	2008年3月31日至2008年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额	17,875,338,760.71
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-17,251,266,983.72
应收利息总额	-201,166,818.06
债券投资收益	422,904,958.93

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 3 月 31 日至 2008 年 12 月 31 日
卖出及到期兑付资产支持证券结算金额	291,605,186.39
卖出及到期兑付资产支持证券成本总额	-286,005,853.66
应收利息总额	-5,126,052.73
资产支持证券投资收益	473,280.00

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2008年3月31日至2008年12月31日
卖出权证成交金额	17,752,749.05
卖出权证成本总额	-13,615,919.03
衍生工具收益	4,136,830.02

7.4.7.16 股利收益

本报告期内本基金无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期

	2008年3月31日至2008年12月31日
1.交易性金融资产	639,516,680.11
——股票投资	-
——债券投资	639,203,293.52
——资产支持证券投资	313,386.59
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	639,516,680.11

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2008年3月31日至2008年12月31日
基金赎回费收入	1,727,419.55
基金转换费收入	296,805.57
合计	2,024,225.12

注：1、本基金A、B类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

2、本基金A类基金份额转换为交银施罗德货币市场证券投资基金所收取的转换费总额的25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2008年3月31日至2008年12月31日
交易所市场交易费用	419,754.48
银行间市场交易费用	88,905.00
合计	508,659.48

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2008年3月31日至2008年12月31日
审计费用	140,000.00
信息披露费	240,000.00
银行汇划费用	75,917.96
帐户维护费	7,500.00
其他	900.00
合计	464,317.96

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

本基金的基金管理人于2009年3月2日宣告2009年度第1次分红，向截至2009年2月27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A/B、C类基金份额持有人，分别按每10份基金份额派发红利0.41元、0.36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”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

7.4.10 本报告期的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

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

关联方名称	本期 2008年3月31日至2008年12月31日
当期应支付的管理费	48,030,112.97
其中：当期已支付	41,824,986.77
期末未支付	6,205,126.20

注：支付基金管理人交银施罗德基金管理有限公司的基金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：日基金管理人报酬＝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

关联方名称	本期 2008年3月31日至2008年12月31日
当期应支付的托管费	16,010,037.70
其中：当期已支付	13,941,662.29
期末未支付	2,068,375.41

注：支付基金托管人中国建设银行的基金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：日基金托管费＝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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称(C类)	本期2008年3月31日至2008年12月31日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
交通银行	5,339,458.62	638,119.89	5,977,578.51
中国建设银行	872,618.50	246,796.53	1,119,415.03

交银施罗德	906,735.44	330,542.83	1,237,278.27
合计	7,118,812.56	1,215,459.25	8,334,271.81

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日的C类基金份额对应的基金资产净值0.4%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给交银施罗德基金管理有限公司，再由交银施罗德基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：日基金销售服务费＝前一日C类基金份额对应的资产净值× 0.4% ÷ 当年天数。

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 2008年3月31日至2008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
交通银行	7,559,810,228.76	2,012,803,167.11	-	-	7,602,800,000.00	2,824,475.11
中国建设银行	-	245,771,260.41	-	-	10,516,000,000.00	3,909,707.32

7.4.10.4各关联方投资本基金的情况

无。

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 2008年3月31日至2008年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	905,354,225.53	6,610,351.36

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

无。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：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	利润分配合计
1	2008-11-14	2008-11-14	0.300	286,389,899.65	118,915,832.63	405,305,732.28
合计			0.300	286,389,899.65	118,915,832.63	405,305,732.28

注：1、本基金于2008年11月17日宣告分红，向截至2008年11月14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A/B类基金份额持有人，按每10份基金份额0.3元派发现金红利。共发放红利250,803,394.47元，其中于2008年11月17日以红利再投资形式发放70,774,859.10元，于2008年11月18日以现金形式发放180,028,535.37元。

2、本基金于2008年11月17日宣告分红，向截至2008年11月14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C类基金份额持有人，按每10份基金份额0.3元派发现金红利。共发放红利154,502,337.81元，其中于2008年11月17日以红利再投资形式发放48,140,973.53元，于2008年11月18日以现金形式发放106,361,364.28元。

7.4.12 期末（2008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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
002257	立立电子	2008-06-30	待定	新股网上申购	21.81	21.81	25,500	556,155.00	556,155.00

注：根据宁波立立电子股份有限公司2008年7月7日发布的公告，有关监管部门要求保荐人等中介机构对媒体报道的有关问题进行核查，上市日期待定。

7.4.12.2期末持有的暂时停牌股票

无。

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2008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2,482,996,520.50元，是以如下债券作为质押：

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
080219	08 国开 19	2009-1-4	103.13	6,000,000	618,780,000.00
080218	08 国开 18	2009-1-5	104.71	2,500,000	261,775,000.00
0801047	08 央行票据 47	2009-1-5	106.90	5,000,000	534,500,000.00
0801047	08 央行票据 47	2009-1-7	106.90	11,500,000	1,229,350,000.00
合计	-	-	-	25,000,000	2,644,405,000.00

7.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2008年12月31日止，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400,000,000.00元，于2009年1月5日前先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票、权证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，其中股票投资仅限于参与新股认购和可转债转股获得的股票，权证投资仅限于参与可分离转债申购而获得的权证，即本基金不从二级市场购买股票或权证。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于货币市场基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

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有风险控制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。风险控制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、风险控制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建设银行，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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券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%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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制的投资品种比例等。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，因此除在附注 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，其余均能及时变现。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。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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，因此存在相应的利率风险。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。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者予以分类。

单位：人民币元

2008 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	905,354,225.53	-	-	-	905,354,225.53
结算备付金	18,242,783.42	-	-	-	18,242,783.42
存出保证金	-	-	-	13,230.50	13,230.50
交易性金融资产	1,150,462,773.70	9,866,401,096.45	2,411,165,004.00	556,155.00	13,428,585,029.15
应收证券清算款	-	-	-	2,006,313.65	2,006,313.65
应收利息	-	-	-	212,571,803.35	212,571,803.35

应收申购款	1,408,515.62	-	-	31,568,623.98	32,977,139.60
资产总计	2,075,468,298.27	9,866,401,096.45	2,411,165,004.00	246,716,126.48	14,599,750,525.20
负债					
卖出回购金融资产	2,882,996,520.50	-	-	-	2,882,996,520.50
应付赎回款	-	-	-	36,239,109.87	36,239,109.87
应付管理人报酬	-	-	-	6,205,126.20	6,205,126.20
应付托管费	-	-	-	2,068,375.41	2,068,375.41
应付销售服务费	-	-	-	1,624,040.73	1,624,040.73
应付交易费用	-	-	-	94,462.69	94,462.69
应交税费	-	-	-	1,035,847.11	1,035,847.11
应付利息	-	-	-	308,417.05	308,417.05
其他负债	-	-	-	413,267.06	413,267.06
负债总计	2,882,996,520.50	-	-	47,988,646.12	2,930,985,166.62
利率敏感度缺口	-807,528,222.23	9,866,401,096.45	2,411,165,004.00	198,727,480.36	11,668,765,358.58

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：2008年12月31日
	市场利率下降 25 个基点	上升 12,861
	市场利率上升 25 个基点	下降 12,635

7.4.13.4.2 外汇风险

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。

7.4.13.4.2 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，包括 VaR(Value at Risk)指标等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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2008年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	556,155.00	0.00
衍生金融资产－权证投资	－	－
其他	－	－
合计	556,155.00	0.00

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2008 年 12 月 31 日，股票等权益类资产占基金资产净值的比例为 0.005%，若除利率和汇率外的其他市场因素变化导致本基金持有的权益性工具的公允价值变动 5%而其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不发生重大变动。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	556,155.00	0.00
	其中：股票	556,155.00	0.00
2	固定收益投资	13,428,028,874.15	91.97
	其中：债券	13,228,284,694.50	90.61
	资产支持证券	199,744,179.65	1.37
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	923,597,008.95	6.33
6	其他资产	247,568,487.10	1.70
7	合计	14,599,750,525.20	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	556,155.00	0.00
C0	食品、饮料	—	—
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	—	—
C5	电子	556,155.00	0.00
C6	金属、非金属	—	—
C7	机械、设备、仪表	—	—
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	—	—
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	556,155.00	0.00

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	002257	立立电子	25,500	556,155.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额占期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600585	海螺水泥	44,699,020.00	0.38
2	601899	紫金矿业	25,860,510.00	0.22
3	601958	金钼股份	19,867,430.00	0.17
4	601766	中国南车	15,567,157.64	0.13
5	002269	美邦服饰	2,235,093.12	0.02
6	002244	滨江集团	1,909,140.00	0.02
7	002240	威华股份	1,467,950.00	0.01
8	002251	步步高	1,151,223.36	0.01
9	002242	九阳股份	912,870.00	0.01
10	002267	陕天然气	810,135.00	0.01
11	002233	塔牌集团	712,130.00	0.01
12	002241	歌尔声学	666,690.00	0.01
13	002257	立立电子	556,155.00	0.00
14	002258	利尔化学	457,710.00	0.00
15	002249	大洋电机	396,800.00	0.00
16	002254	烟台氨纶	381,095.00	0.00
17	002264	新华都	335,844.00	0.00

18	002250	联化科技	310,340.00	0.00
19	002266	浙富股份	271,510.00	0.00
20	002252	上海莱士	262,605.00	0.00

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 累计卖出金额占期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600585	海螺水泥	39,572,871.42	0.34
2	601899	紫金矿业	36,551,198.08	0.31
3	601766	中国南车	29,126,966.53	0.25
4	601958	金钼股份	25,009,130.50	0.21
5	002269	美邦服饰	2,889,531.72	0.02
6	002244	滨江集团	2,442,537.70	0.02
7	002240	威华股份	1,967,495.00	0.02
8	002251	步步高	1,875,305.00	0.02
9	002242	九阳股份	1,801,223.00	0.02
10	002233	塔牌集团	1,173,001.00	0.01
11	002241	歌尔声学	1,165,376.35	0.01
12	002267	陕天然气	1,137,350.30	0.01
13	002258	利尔化学	709,521.00	0.01
14	002254	烟台氨纶	529,978.00	0.00
15	002264	新华都	525,815.34	0.00
16	002249	大洋电机	456,283.76	0.00
17	002252	上海莱士	430,973.28	0.00
18	002266	浙富股份	429,459.00	0.00
19	002235	安妮股份	428,892.72	0.00
20	002250	联化科技	398,350.83	0.00

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

买入股票成本（成交）总额	121,945,497.92
卖出股票收入（成交）总额	153,356,258.13

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	763,634,000.00	6.54
2	央行票据	4,018,835,000.00	34.44
3	金融债券	5,551,194,000.00	47.57
	其中：政策性金融债	5,468,568,000.00	46.87
4	企业债券	2,792,881,694.50	23.93
5	企业短期融资券	101,740,000.00	0.87
6	其他	-	-
7	合计	13,228,284,694.50	113.36

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	0801047	08央行票据47	18,500,000	1,977,650,000.00	16.95
2	0801044	08央行票据44	11,500,000	1,228,775,000.00	10.53
3	080216	08国开16	10,500,000	1,129,800,000.00	9.68
4	080311	08进出11	7,500,000	764,475,000.00	6.55
5	080219	08国开19	6,000,000	618,780,000.00	5.30

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	0830012	08开元1A2	2,000,000	96,000,000.00	0.82
2	0838014	08信银B	400,000	40,148,000.00	0.34
3	0830013	08开元1B	300,000	29,886,000.00	0.26
4	119010	天电收益	400,000	20,096,773.70	0.17
5	119005	浦建收益	400,000	13,613,405.95	0.12

8.8 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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,230.50
2	应收证券清算款	2,006,313.65
3	应收股利	-
4	应收利息	212,571,803.35
5	应收申购款	32,977,139.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	247,568,487.10

8.9.4 本基金本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002257	立立电子	556,155.00	0.00	网上申购新股未流通

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§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

份额级别	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
A/B类	40,365	158,819.39	3,416,884,510.60	53.30%	2,993,860,204.93	46.70%
C类	40,717	103,443.45	839,807,331.36	19.94%	3,372,099,653.64	80.06%
合计	81,082	131,011.22	4,256,691,841.96	40.07%	6,365,959,858.57	59.93%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	A/B类	719,238.07	0.01%
	C类	1,625,579.57	0.02%
	合计	2,344,817.64	0.02%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项　　目	A/B类	C类
基金合同生效日(2008年03月31日)基金份额总额	7,419,837,721.23	2,902,969,397.22
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,676,485,949.11	10,585,505,301.24
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-7,685,578,954.81	-9,276,567,713.46
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
报告期期末基金份额总额	6,410,744,715.53	4,211,906,985.00

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§11 重大事件揭示

11.1 报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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：

2008年2月22日本基金管理人发布公告，经交银施罗德基金管理有限公司第一届董事会第二十四次会议通过，免去公司董事长谢红兵先生的职务，选举彭纯先生担任公司董事长；免去公司总经理雷贤达先生的职务，选举莫泰山先生担任公司总经理；选举雷贤达先生担任公司副董事长。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2008年6月13日，中国证券监督管理委员会核准本行投资托管服务部副总经理纪伟的高级管理人员任职资格。

11.3 报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 基金改聘会计师事务所情况

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。报告年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的审计费140,000元，该审计机构首次为本基金提供审计服务。

11.6 报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
中信证券股份有限公司	1	130,260,166.53	84.94%	126,958.77	87.12%	—
中银国际证券有限责任公司	1	23,096,091.60	15.06%	18,765.74	12.88%	—

券商名称	交易单元数量	债券交易		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	
中信证券股份有限公司	1	1,985,142,809.01	87.31%	—
中银国际证券有限责任公司	1	288,539,665.81	12.69%	—

券商名称	交易单元数量	债券回购交易		备注
		成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	
中信证券股份有限公司	1	20,317,000,000.00	100%	—
中银国际证券有限责任公司	1	—	—	—

券商名称	交易单元数量	权证交易		备注
		成交金额	占当期权证成交总额的比例	
中信证券股份有限公司	1	17,752,749.05	100%	—

中银国际证券有限责任公司	1	—	—	—

注： 1、报告期内，本基金的 2 个专用交易席位均为新增加席位；

2、租用证券公司专用席位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、租用证券公司专用席位的程序：首先根据租用证券公司专用席位的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金专用席位。研究部提交方案，并上报公司批准。

11.8 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	交银施罗德增利债券证券投资基金招募说明书、基金合同摘要、基金份额发售公告	中国证券报	2008-02-26
		上海证券报	2008-02-27
		证券时报	2008-02-28
2	交银施罗德基金管理有限公司关于增加交银施罗德增利债券证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-02-29
3	交银施罗德基金管理有限公司关于增加联合证券有限责任公司为交银施罗德增利债券证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-03-04
4	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中国银行股份有限公司和广发证券股份有限公司为交银施罗德增利债券证券投资基金场外代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-03-05
5	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中信证券股份有限公司为交银施罗德增利债券证券投资基金场外代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-03-10
6	交银施罗德增利债券证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-03-20
7	交银施罗德基金管理有限公司关	中国证券报、上海证券报、	2008-03-20

	于增加中银国际证券有限责任公司为交银施罗德增利债券证券投资基金场外代销机构的公告	证券时报	
8	交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-04-01
9	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中信银行股份有限公司为旗下部分基金场外代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-04-09
10	交银施罗德增利债券证券投资基金开放申购及赎回业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-05-06
11	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德增利债券证券投资基金开办定期定额投资计划业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-05-07
12	交银施罗德基金管理有限公司关于暂停交银施罗德增利债券证券投资基金A类基金份额网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-05-09
13	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德增利债券证券投资基金在中国农业银行开办定期定额赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-05-16
14	交银施罗德基金管理有限公司关于增加国元证券股份有限公司为旗下基金场外代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-05-16
15	交银施罗德基金管理有限公司关于开通交银施罗德增利债券证券投资基金A类基金份额网上直销业务并推出前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-05-19
16	交银施罗德基金管理有限公司关于开通交银施罗德增利债券证券	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-05-22

	投资基金转换业务的公告		
17	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国建设银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-05-22
18	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行定期定额业务前端申购费率优惠活动的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-05-28
19	交银施罗德增利股票证券投资基金季度报告（2008年第二季度）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-07-19
20	交银施罗德基金管理有限公司关于调整中国农业银行金穗借记卡网上直销业务前端申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-08-29
21	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下货币型基金和债券型基金“十一”假期前暂停申购和转换入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-09-22
22	交银施罗德基金管理有限公司关于增加旗下基金场外代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-10-15
23	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中国光大银行股份有限公司为旗下基金场外代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-10-17
24	交银施罗德增利股票证券投资基金季度报告（2008年第三季度）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-10-22
25	交银施罗德基金管理有限公司关于增加宏源证券股份有限公司为旗下部分基金场外代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-10-27
26	交银施罗德基金管理有限公司关	中国证券报、上海证券报、	2008-10-30

	于增加中国民生银行股份有限公司为交银施罗德增利债券证券投资基金场外代销机构的公告	证券时报	
27	交银施罗德基金管理有限公司关于中国工商银行延长其个人网上银行基金前端申购费率优惠期的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-11-10
28	交银施罗德增利债券证券投资基金第一次分红预告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-11-10
29	交银施罗德增利债券证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2008年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-11-14
30	交银施罗德增利债券证券投资基金第一次分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-11-17
31	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德增利债券证券投资基金招募说明书（更新）摘要的更正公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-11-21
32	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德增利债券证券投资基金限制大额申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-11-26
33	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德增利债券证券投资基金招募说明书（更新）的更正公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-11-26
34	交银施罗德基金管理有限公司关于开通中国农业银行金穗借记卡网上直销定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-12-12
35	交银施罗德基金管理有限公司关于增加天相投资顾问有限公司为旗下基金场外代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-12-17

36	交银施罗德基金管理有限公司关于调整中国建设银行龙卡借记卡网上直销业务前端申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-12-30
37	交银施罗德基金管理有限公司关于取消交银施罗德增利债券证券投资基金大额申购及转换入业务限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2008-12-30

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

1、2008年5月27日，本行发布关于美国银行公司行使认购期权的公告，美国银行公司将根据与中央汇金投资有限责任公司于2005年6月17日签订的《股份及期权认购协议》行使认购期权；

2、2008年9月23日，本行公告关于控股股东中央汇金投资有限责任公司增持本行股份的公告；

3、2008年11月17日，本行公告美国银行公司行使认购期权的事宜；

4、2008年12月2日，中央汇金投资有限责任公司与美国银行公司公布简式权益变动报告书。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德增利债券证券投资基金募集的文件；

2、《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德增利债券证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德增利债券证券投资基金托管协议》；

5、关于募集交银施罗德增利债券证券投资基金之法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照；

8、报告期内交银施罗德增利债券证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

13.3 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.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。