

交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

2011 半年度报告摘要

Table with columns: 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(%)

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.6 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

Table with columns: 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(%)

7.7 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

7.8 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

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 本基金投资的前十名股票中,未有超出基金合同约定的持股比例之外的股票。

Table with columns: 序号, 名称, 金额

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with columns: 持有人数(户), 机构持有基金份额, 个人投资者持有基金份额

8.2 期末本基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

Table with columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金总份额比例

9 开放式基金份额变动 单位:份

Table with columns: 基金合同生效日, 2010年6月30日, 基金份额总额

注: 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投资业务,则总份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转出业务,则赎回份额中包含该业务。

10.1 基金份额持有人大会决议

10.2 基金管理人的基金托管人、专门基金托管部门的重大人事变动

10.3 涉及与基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

10.5 报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.6 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。

10.7 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

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交总额的比例, 佣金, 占当期佣金总额的比例

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:券商综合实力、财务状况和经营状况;

3、租用证券公司专用交易单元的选择程序: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,然后按照评价结果选择基金专用交易单元。

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

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 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》、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:

0 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。

1 对基金取得的股票股息、利息收入,由发行债券的企业在派发股息利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。

2 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在派发股息利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。

3 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

4 基金卖出股票按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。

6.4.7 关联方关系 6.4.7.1 关联方关系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

6.4.7.2 本报告期间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

6.4.7.3 本报告期间与基金发生关联交易的重大关联方

Table with columns: 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”) 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”) 基金管理人、基金代销机构

注:下述关联方均在正常业务范围内按一般商业条件订立。

6.4.8 本报告期间及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.2 关联方报酬

Table with columns: 项目, 本期, 上期

当期发生的基金应支付的托管费 1,377,138.88

注:支付基金托管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1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

6.4.8.2.3 销售服务费

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table with columns: 项目, 本期, 上期

6.4.8.4.2 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

6.4.8.5 本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况

6.4.8.6 本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无产生的利息收入

Table with columns: 关联方名称, 本期, 上期

注:本基金“银行存款”由基金托管人中国建设银行托管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6.1 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

6.4.8.6.2 报告期内本基金未在承销期间参与关联方承销证券。

6.4.8.6.3 报告期内本基金未发生其他关联交易事项。

6.4.8.6.4 期末 2011年6月30日 本基金持有的流通受限证券

6.4.8.6.5 因认购新发增发的证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.8.6.6 于本报告期末,本基金未持有因认购新发增发的证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.8.6.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.6.8 报告期内本基金未发生其他关联交易事项。

6.4.9 期末 2011年6月30日 本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发增发的证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.9.2 于本报告期末,本基金未持有因认购新发增发的证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.3 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 停牌日期, 停牌原因, 期末停牌期间, 复牌日期, 复牌开盘日期, 数量(股), 期末公允价值, 期末估值总额, 备注

注:本基金截至2011年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.9.4 期末债券正回购交易中作为质押的债券

于本报告期末,本基金无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。

的公平、合理,保持估值政策和程序的一致性。估值委员会的研究成员或投资顾问的不同意见,研究并参考市场普遍认同的做法,建议合理的估值模型,由基金经理进行审核和认定,并报各估值委员会成员或基金会计、风控、合规等方面审批。一致同意后,报公司投资决策委员会、总经理审批。

估值委员会定期评估估值政策和程序的有效性及适用性的情况下,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公允价值、信息披露情况保持应有的职业谨慎,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,提供估值参考信息未与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期间,根据相关法律法规和基金合同约定,本基金对上一年度应分配的可供利润分配进行了一次收益分配,具体情况参见半年度报告正文6.4.11 利润分配。

截止本报告期末,根据相关法律法规及基金合同约定,本基金无应分配但尚未实施的利润。

5 托管人报告

5.1 报告期内,中国建设银行履行托管职责情况

本报告期间,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

本报告期间,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关基金资产净值的行为。

5.3 托管人对上半年度报告中财务信息内容的真实、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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2011年6月30日

Table with columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末

资产: 银行存款 7.4.7.1 105,506,229.48 175,520,204.44

结算备付金 774,715.38 2,994,989.71

存出保证金 166,446.38 325,356.06

交易性金融资产 7.4.7.2 899,605,153.15 1,108,761,766.11

其中:股票投资 780,873,153.15 889,881,766.11

基金投资 118,732,000.00 218,880,000.00

资产支持证券投资 7.4.7.3 - -

买入返售金融资产 7.4.7.4 - 100,000,000.00

应收证券清算款 - -

应收利息 7.4.7.5 3,176,839.92 4,557,649.84

应收股利 280,343.28 -

应收申购款 86,693.73 1,767,933.64

其他资产 7.4.7.6 - -

负债和所有者权益 附注号 本期末 上年度末

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 - -

应付证券清算款 - 100,000,932.15

应付赎回款 1,999,381.11 1,429,581.47

应付管理人报酬 1,211,778.80 1,676,677.65

应付托管费 201,963.13 279,446.29

应付销售服务费 7.4.7.7 799,575.05 1,625,871.20

应交税费 68,500.00 68,500.00

应付利息 - -

应付利润 - -

递延所得税负债 7.4.7.8 - 292,191.38

负债合计 4,481,063.37 105,373,200.14

所有者权益: 实收基金 7.4.7.9 970,611,974.66 1,144,468,160.70

未分配利润 34,503,383.69 144,086,538.96

所有者权益合计 1,005,115,358.35 1,288,554,699.66

负债和所有者权益总计 1,009,596,421.72 1,393,927,899.80

注:1、报告截止日2011年6月30日,基金份额总额970,611,974.66份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解附注的全部内容,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体:交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上期

一、收入 附注号 本期 上期

1.利息收入 3,610,694.73 3,610,694.73

其中:存款利息收入 7.4.7.11 419,231.43 419,231.43

债券利息收入 3,183,760.54 3,183,760.54

资产支持证券利息收入 - -

买入返售金融资产收入 - -

其他利息收入 - 7,172.76

2.投资收益(损失以“-”填列) 14,233,983.53 14,233,983.53

其中:股票投资收益 10,493,352.74 10,493,352.74

基金投资收益 - -

债券投资收益 7.4.7.13 - -

资产支持证券投资 - -

衍生工具收益 7.4.7.14 - -

股利收益 7.4.7.15 5,460,629.59 5,460,629.59

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) 7.4.7.16 -81,501,634.78

4.汇兑收益(损失以“-”号填列) - -

5.其他收入(损失以“-”号填列) 7.4.7.17 415,880.48

减:费用 13,353,737.00

1.管理人报酬 - 1,377,138.88

2.托管费 - 279,446.29

3.销售服务费 7.4.7.18 799,575.05 1,625,871.20

4.利息支出 - 3,503,497.54

5.利息支出 7.4.7.19 - 210,267.40

6.其他费用 7.4.7.20 - 76,594,802.84

7.其他费用(亏损总额以“-”号填列) - -

所得税费用 7.4.7.21 1,099,596,421.72

四、净利润(净亏损以“-”号填列) -76,594,802.84

注:本基金于2010年6月30日成立,成立当日无实质性交易。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

Table with columns: 项目, 本期, 上期

一、期初所有者权益(基金净值) 1,144,468,160.70 1,144,468,160.70

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) - -76,594,802.84

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) -173,856,186.04 -190,232,816.82

其中:1.基金申购款 131,803,138.39 11,611,280.50

2.基金赎回款 -305,659,324.43 -27,987,910.48

四、本期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) - -16,611,722.45

五、期末所有者权益(基金净值) 970,611,974.66 34,503,383.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人:公司负责人:陈龙,主管会计工作负责人:许珊珊,机构部门负责人:张丽

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金(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]624号《关于核准交银施罗德主题优选灵活配置混合型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《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金合同》(以下简称“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3,234,778,164.71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[2010]第166号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金合同》于2010年6月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,235,642,950.36份基金份额,其中认购资金利息折合864.755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《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、招募说明书及其定期更新的有关规定,本基金的基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的基金资产投资于股票资产的比例为30%-80%,债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例合计不超过基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:60%沪深300指数收益率+40%中国标普全指综合指数收益率。

6.4.2 会计报表编制基础

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”)、中国证券监督管理委员会《2010 5号 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>》、中国证券业协会于2007年1月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金合同和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。

6.4.3 2011年上半年度财务报表编制基础

本基金的2011年上半年度财务报表按照企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2011年6月30日的财务状况以及2011年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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保持一致。

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保持一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的差错更正。

6.4.6 本报告期与基金托管人核对一致

本报告期末,本基金托管人按照《证券投资基金法》、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关基金资产净值的行为。

6.4.7 本报告期与基金托管人核对一致

本报告期末,本基金托管人按照《证券投资基金法》、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关基金资产净值的行为。

6.4.8 本报告期与基金托管人核对一致

本报告期末,本基金托管人按照《证券投资基金法》、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关基金资产净值的行为。

6.4.9 本报告期与基金托管人核对一致

本报告期末,本基金托管人按照《证券投资基金法》、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关基金资产净值的行为。

6.4.10 本报告期与基金托管人核对一致

本报告期末,本基金托管人按照《证券投资基金法》、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、