

交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

[2012] 第二季度报告

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月十八日

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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月17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,保留下虚假记载、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§ 1 基金产品概况

基金简称 交银施罗德主题优选混合
基金主代码 519700
交易代码 519700(前端) 519701(后端)

基金运作方式 灵活的开放式

基金合同生效日 2010年6月30日

报告期末基金份额总额 1,114,199,651.77份

本基金力图通过前瞻性的主题优选,积极把握行业和个股的投资机会,在控制风险并保持其资金良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金充分考虑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风格相结合,在分析和判断宏观经济发展趋势、经济周期和市场变化趋势的基础上,动态调整投资组合比例,自上而下灵活配置资产;通过主题优选策略和挖掘个股具有良好增长前景的行业进行结合的方式,精选个股,以求实现收益。

业绩比较基准 60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率

风险收益特征 本基金是一只灵活配置的混合型基金,属于基金中的中高风险品种。本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

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

§ 2 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(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 3,593,155.26

2.本期利润 56,395,641.65

3.加权平均基金份额本期利润 0.0520

4.期末基金份额净值 1,018,462,186.37

5.期末基金份额净值 0.9194

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不计费用的收益率;
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)扣除相关费用后的余额;

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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变动的比较

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

份额累计净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.3 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.4 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.5 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.6 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.7 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.8 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.9 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.10 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.11 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.12 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.13 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.14 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.15 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.16 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.17 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.18 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.19 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.20 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.21 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.22 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.23 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.24 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.25 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.26 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.27 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.28 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.29 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.30 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.31 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.32 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.33 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.34 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.35 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.36 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.37 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.38 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.39 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日

该图显示了本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

3.2.40 份额净值增长率与历史走势对比图

2010年6月30日至2012年6月30日