

2012年7月18日 星期三

交银施罗德主题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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月十八日

§1 重要提示
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。
基金托管人中国工商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等信息,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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银主题灵活混合
基金代码	519700
交易代码	519700(前端)
基金运作方式	契约型开放式
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
投资目标	本基金力图通过前瞻性的主题投资,积极把握行业和个股投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥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资风格相结合,在分析判断宏观经济发展趋势、经济周期和市场环境变化趋势的基础上,动态调整投资组合比例,自上而下灵活配置资产;通过优选主题配置和挖掘个股具有良好增长前景的优势行业相结合的方式,精选个股,以谋求超额收益。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中债富时基金指数收益率
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	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

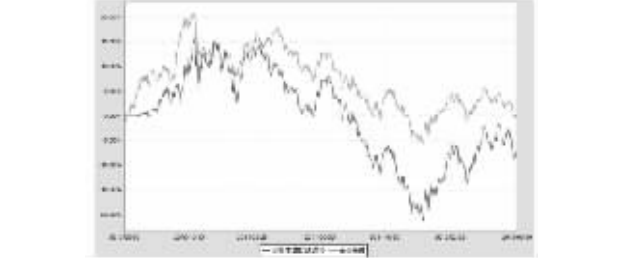
3.1 主要财务指标

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.期末基金资产净值	1,018,462,186.37
5.期末基金份额净值	0.914

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,其中公允价值变动收益计入公允价值变动收益。
3.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①	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
过去三个月	6.40%	1.25%	1.04%	0.67%	5.36%	0.58%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩表现与业绩比较基准收益率变动的比较
交银施罗德主题灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2010年6月30日至2012年6月30日



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束及本报告期末,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 基金经理

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理期限	证券从业年限	说明
史伟	本基金的基金经理 交银施罗德主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理 交银施罗德主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2010-6-30	-	11年 史伟先生,英国雷丁大学经济学硕士,历任东方证券证券投资部行业研究员,华夏基金基金经理,加入交银施罗德基金管理有限公司。
李永兴	本基金的基金经理	2012-3-20	-	6年 李永兴先生,经济学硕士,2006年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任投资研究部研究员,基金基金经理。

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,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金严格执行了公平交易制度,确保基金资产在公平、公开、透明的原则下,按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等进行投资管理,确保基金资产在公平、公开、透明的原则下,按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等进行投资管理,确保基金资产在公平、公开、透明的原则下,按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等进行投资管理。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金报告期内未发生异常交易行为,报告期内本基金投资组合未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
沪深300指数二季度上涨了0.27%,呈现底部震荡的格局。本基金净值上涨7.64%,高于沪深300指数及业绩比较基准的增长幅度。

4.5 报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度,公平对待下各投资组合,本基金组合与公募基金管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别、股票、债券的收益并未发现异常差异。

4.6 报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度,公平对待下各投资组合,本基金组合与公募基金管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别、股票、债券的收益并未发现异常差异。

§5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	812,084,243.88	79.31
2	其中:股票	812,084,243.88	79.31
3	固定收益投资	149,481,500.00	14.60
4	其中:债券	149,481,500.00	14.60
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	58,566,091.19	5.72
9	其他各项资产	3,868,427.90	0.38
10	合计	1,024,000,262.97	100.00

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。

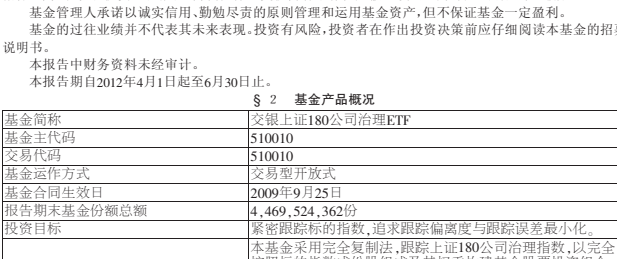
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.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①	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
过去三个月	1.75%	1.14%	0.02%	1.12%	1.73%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩表现与业绩比较基准收益率变动的比较
自基金合同生效以来基金业绩表现与业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3个月。截至建仓期结束及本报告期末,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。

§4.1 基金经理(基金经理小组)简介

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理期限	证券从业年限	说明
史伟	本基金的基金经理 交银施罗德主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理 交银施罗德主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2010-6-30	-	11年 史伟先生,英国雷丁大学经济学硕士,历任东方证券证券投资部行业研究员,华夏基金基金经理,加入交银施罗德基金管理有限公司。
李永兴	本基金的基金经理	2012-3-20	-	6年 李永兴先生,经济学硕士,2006年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任投资研究部研究员,基金基金经理。

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,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金严格执行了公平交易制度,确保基金资产在公平、公开、透明的原则下,按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等进行投资管理,确保基金资产在公平、公开、透明的原则下,按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等进行投资管理,确保基金资产在公平、公开、透明的原则下,按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等进行投资管理。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金报告期内未发生异常交易行为,报告期内本基金投资组合未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
沪深300指数二季度上涨了0.27%,呈现底部震荡的格局。本基金净值上涨7.64%,高于沪深300指数及业绩比较基准的增长幅度。

4.5 报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度,公平对待下各投资组合,本基金组合与公募基金管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别、股票、债券的收益并未发现异常差异。

4.6 报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度,公平对待下各投资组合,本基金组合与公募基金管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别、股票、债券的收益并未发现异常差异。

§5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采掘业	86,126,036.62	8.46
C	制造业	229,203,620.59	22.50
D	食品饮料	-	-
E	纺织服装、皮毛	-	-
F	木材、家具	-	-
G	造纸、印刷	-	-
H	化学、橡胶、塑料	-	-
I	金属、非金属	12,567,542.40	1.23
J	机械、设备、仪表	119,387,683.50	11.72
K	医药、生物制品	97,248,394.69	9.55
L	其他制造业	-	-
M	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
N	交通运输、仓储业	53,565,233.93	5.26
O	信息技术业	9,122,065.30	0.90
P	批发和零售贸易	-	-
Q	金融、保险业	173,600,089.56	17.05
R	房地产业	216,624,631.00	21.27
S	社会服务业	43,842,568.88	4.30
T	传播与文化业	-	-
M	合计	812,084,243.88	79.74

§5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000024	招商地产	2,286,773	56,094,541.69	5.51
2	601318	中国平安	1,211,968	55,435,416.32	5.44
3	600048	保利地产	4,362,035	49,465,476.90	4.86
4	601336	新华保险	1,353,746	46,352,263.04	4.55
5	000002	万科A	5,168,219	46,048,831.29	4.52
6	000069	华侨城A	6,871,876	43,842,568.88	4.30
7	002146	荣盛发展	3,120,804	34,016,763.60	3.34
8	000960	锡业股份	1,644,342	32,393,576.80	3.18
9	600383	金地集团	4,783,799	30,999,017.52	3.04
10	000878	云南铜业	1,716,047	30,717,241.30	3.02

§5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债	20,186,000.00	1.98
6	企业短期融资券	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	149,481,500.00	14.68

§5.5 报告期末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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	500,000	54,495,000.00	5.35
2	113001	中行转债	300,000	29,136,000.00	2.86
3	110003	新股转债	260,000	25,682,500.00	2.52
4	108007	103转债	200,000	20,186,000.00	1.98
5	110015	石化转债	200,000	19,982,000.00	1.96

§5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

§5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

§5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.8.2 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。

§5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	140,071.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,252,878.50
4	应收利息	1,456,585.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,018,892.06
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,868,427.90

§5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	54,495,000.00	5.35
2	113001	中行转债	29,136,000.00	2.86
3	110003	新股转债	25,682,500.00	2.52
4	110015	石化转债	19,982,000.00	1.96

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
交银施罗德主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

1. 交银施罗德主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

2. 由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份
本报告期初基金份额总额
本报告期基金申购份额
减:本报告期基金赎回份额
本报告期基金份额变动
本报告期末基金份额总额

注:1.如果本报告期间发生转入、赎回再投资业务,则总申购份额中包含该业务;

2.如果本报告期间发生转出业务,则总赎回份额中包含该业务。

§7 备查文件目录

1. 中国证监会核准交银施罗德主题灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2. 交银施罗德主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同;

3. 交银施罗德主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书;

4. 交银施罗德主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议;

5. 关于募集交银施罗德主题灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书;

6. 基金托管人业务资格批件、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主题灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9. 存放地点
备查文件存放于基金管理人处。

10. 查阅方式
投资者可在办公时间内至基金管理人处或基金管理人网站,或者登录基金管理人的网站

www.jfund.com, www.jsrd.com, www.hoomechneider.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印件或复印件。

投资者对本报告如有疑问,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@jsrd.com。

§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,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金严格执行了公平交易制度,确保基金资产在公平、公开、透明的原则下,按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等进行投资管理,确保基金资产在公平、公开、透明的原则下,按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等进行投资管理,确保基金资产在公平、公开、透明的原则下,按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等进行投资管理。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金报告期内未发生异常交易行为,报告期内本基金投资组合未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
沪深300指数二季度上涨了0.27%,呈现底部震荡的格局。本基金净值上涨7.64%,高于沪深300指数及业绩比较基准的增长幅度。

4.5 报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度,公平对待下各投资组合,本基金组合与公募基金管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别、股票、债券的收益并未发现异常差异。

4.6 报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度,公平对待下各投资组合,本基金组合与公募基金管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别、股票、债券的收益并未发现异常差异。

§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,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金严格执行了公平交易制度,确保基金资产在公平、公开、透明的原则下,按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等进行投资管理,确保基金资产在公平、公开、透明的原则下,按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等进行投资管理,确保基金资产在公平、公开、透明的原则下,按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等进行投资管理。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金报告期内未发生异常交易行为,报告期内本基金投资组合未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
沪深300指数二季度上涨了0.27%,呈现底部震荡的格局。本基金净值上涨7.64%,高于沪深300指数及业绩比较基准的增长幅度。

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联接基金

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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月十八日

§1 重要提示
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。
基金托管人中国工商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等信息,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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上证180公司治理ETF联接
基金代码	519086
交易代码	519086(前端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月25日
报告期末基金份额总额	3,965,068,380.35份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法,跟踪上证180公司治理指数,以完全按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。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而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,紧密跟踪标的指数,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称 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9月25日

基金托管人名称 交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人名称 中国工商银行股份有限公司