

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:二〇一三年八月二十六日

重要提示

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构在编制基金年度报告过程中,严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《证券投资基金信息披露编报规则》等法律法规及中国证监会的有关规定,勤勉尽责,保证基金年度报告内容的真实性、准确性和完整性,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。本半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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司(以下使用全称或其简称“中国建设银行”)根据本基金合同规定,于2013年8月25日复核了本报告中财务数据、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,保证报告内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本报告旨在提供信息,不构成任何投资建议,投资者应根据自身情况自行做出投资判断。基金管理人不对任何因使用本报告内容而造成的损失承担责任。
基金管理人中国建设银行股份有限公司(以下使用全称或其简称“中国建设银行”)根据本基金合同规定,于2013年8月25日复核了本报告中财务数据、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,保证报告内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告中财务数据未经审计。

本报告自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

2.1 基金基本情况	2 基金简介
基金名称	交银主题优选混合
基金代码	519700
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
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
报告期末基金份额总额	865,461,334.58份
报告期末资产净值	不定期
2.2 基金产品说明	

投资目标
本基金力图通过前瞻性的主题优选,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,在分析和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,自上而下采取资产配置策略,通过精选主题配置和精选个股实现长期增长前景的优异业绩相融合的方式,精选个股,以求超额收益。
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股票型基金,属于基金中的中高风险品种,本基金的风险与预期收益高于股票型基金和债券型基金之间。

2.3 基金管理人及基金托管人	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
姓名	姓名	姓名
信息披露负责人	联系电话	021-61055050
信息披露负责人	电子邮箱	xsp@jysd.com, disclosure@jysd.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	010-67595006
传真	021-61055054	010-67595006

2.4 信息披露方式
登载基金半年度报告正文的
管理人互联网网址
基金半年度报告备置地点

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	62,155,817.01
本期平均净值	-150,214,693.64
加权平均基金份额本期利润	-0.1549
本期基金份额净值增长率	-18.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.247
期末基金份额净值	651,867,156.01
期末基金份额净值	0.753

注:1.本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收益。

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 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

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
过去一个月	-16.05%	1.62%	-9.68%	1.14%	-6.37%	0.48%
过去三个月	-16.80%	1.43%	-6.76%	0.88%	-10.04%	0.55%
过去六个月	-18.68%	1.40%	-6.63%	0.91%	-12.05%	0.49%
过去一年	-17.61%	1.35%	-4.61%	0.83%	-13.00%	0.52%
过去三年	-23.65%	1.22%	-3.72%	0.83%	-19.93%	0.39%
自基金合同生效起至今	-23.65%	1.21%	-4.33%	0.83%	-19.32%	0.38%

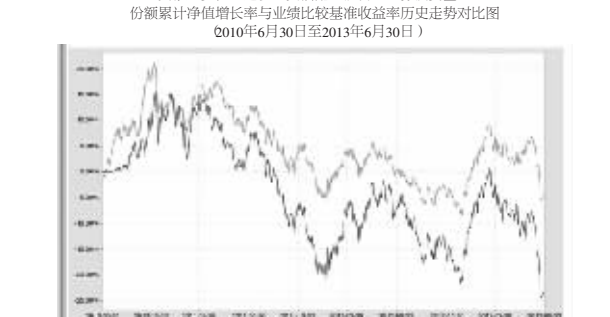
注:本基金的业绩比较基准为60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率,每日进行再平衡过程。

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

交银施罗德主题优选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

Q010年6月30日至2013年6月30日



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起6个月。截至建仓期结束,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14日成立的合资基金管理公司。公司总部设在上海,注册资本2亿元人民币,截止2013年6月30日,公司已发行并管理的基础基金共有二十八只: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)、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)、交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金(基金合同生效日:2009年1月21日)、交银施罗德先锋股票证券投资基金(基金合同生效日:2009年4月10日)、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(基金合同生效日:2009年9月29日)、交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金(基金合同生效日:2010年6月30日)、交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金(基金合同生效日:2010年12月22日)、交银施罗德信用利债债券证券投资基金(基金合同生效日:2011年1月27日)、交银施罗德中证指数证券投资基金(基金合同生效日:2011年6月22日)、上证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金(基金合同生效日:2011年9月22日)、交银施罗德双核债券证券投资基金(基金合同生效日:2011年9月26日)、交银施罗德保本基金交易型开放式指数证券投资基金联接基金(基金合同生效日:2011年10月28日)、交银施罗德全球自然资源证券投资基金(基金合同生效日:2012年5月22日)、交银施罗德安保本混合型证券投资基金(基金合同生效日:2012年6月20日)、交银施罗德阿尔法核能主题证券投资基金(基金合同生效日:2012年8月3日)、交银施罗德21天债券证券投资基金(基金合同生效日:2012年11月7日)、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金(基金合同生效日:2012年12月19日)、交银施罗德理财60天债券证券投资基金(基金合同生效日:2013年3月15日)、交银施罗德双轮驱动债券证券投资基金(基金合同生效日:2013年4月18日)、交银施罗德保本保本基金型证券投资基金(基金合同生效日:2013年4月24日)和交银施罗德成长30股债混合型证券投资基金(基金合同生效日:2013年6月5日)。

4.1.2 基金基金经理(或基金经理助理)的简介

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

姓名 职务 任本基金基金经理(助理)期限

交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

较基准增长率为-6.63%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,如果经济增长不明朗的局面持续下去,那么当前股票市场严重分化的格局可能也将延续;一旦经济增长有了明确的方向,市场也将根据经济的变化而发生变化。本基金将根据经济增长预期的变化对股票仓位和持仓结构做出相应调整。

4.6 管理人对于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员、基金运营部、风险管理部等人员 and 估值委员会人员及基金估值组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关法规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致。估值委员会定期或不定期对投资品种的不同性质,研究并参与市场管理认同的做法,建立合理的估值模型,由量化投资进行管理和验证,确认后交各估值委员会成员从基金仓位、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,在发生可能影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况下,及时召开临时会议进行研究,及时修订估值方法,以保持其持续适用。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政策的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人履行职责情况

本报告期,中国建设银行按照有关规定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基金法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基础基金净值计算、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损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本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数据、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,保证报告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:2013年6月30日

单位:人民币元

资产

附注号

本期末

2013年6月30日

上年度末

2012年12月31日

资产:

银行存款

6.4.7.1

47,058,315.10

68,190,334.45

结算备付金

179,000.93

1,225,011.29

卖出回购金融资产

6.4.7.2

606,360,919.91

953,790,869.02

其中:股票投资

502,857,872.31

811,760,163.42

基金投资

103,502,860.60

141,949,705.60

资产支持证券投资

衍生金融资产

6.4.7.3

-

买入返售金融资产

6.4.7.4

-

应收证券清算款

6.4.7.5

1,080,492.44

878,485.84

应收股利

230,413.91

729,434.44

应收申购款

6.4.7.6

-

其他资产

655,220,468.15

1,024,886,277.75

资产总计

附注号

本期末

2013年6月30日

上年度末

2012年12月31日

负债和所有者权益

负债:

短期借款

交易性金融负债

6.4.7.3

-

衍生金融负债

卖出回购金融资产款

应付证券清算款

应付赎回款

1,004,470.52

771,901.95

应付管理人报酬

887,079.38

1,208,262.59

应付托管费

147,846.57

201,377.10

应付销售服务费

6.4.7.7

340,480.47

653,625.43

应交税费

805,300.00

805,300.00

应付利息

应付利润

应付股利

6.4.7.8

178,135.20