

交银施罗德成长股票证券投资基金

[2011] 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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§ 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,并对其实质性、准确性、完整性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月10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。

本公司对本财务资料未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	交银施罗德成长股票
基金代码	519692(前端)
交易代码	519692(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月23日
报告期末基金份额总额	2,208,442,093.68份

本基金属成长型股票基金,主要通过投资于经过严格的品牌筛选,并具有较高成长性的上市公司的股票,在适度控制风险并保持基金良好流动性的前提下,为基金份额持有人谋取长期、稳定的资本增值。

本基金充分发掘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增长和行业景气变化,以及上市公司成长潜力的基础上,精选具有成长性的股票,以求实现超额收益。

业绩比较基准75%的中国A股指数+25%的富时中国国债指数。

本基金是一只股票基金,具有良好成长的公司为主要投资对象,追求超额收益。属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险的品种。

基金管理人交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)

1.本期已实现收益 -38,074,989.01

2.本期利润 -45,493,384.13

3.加权平均基金份额本期利润 0.0215

4.期末基金份额净值 5,912,275,355.83

5.期末基金份额总额 2,6771

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未计费用的水平;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.基金合同生效日,本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

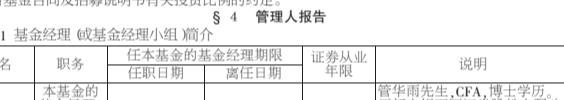
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.06%	0.97%	-4.42%	0.85%	3.36% 0.12%

3.2.2 基金合同生效以来基金份额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

交银施罗德成长股票证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率走势图(2006年10月23日至2011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2011年6月30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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(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
管华丽	本基金的基金经理、理财总监、基金经理、公司权益投资总监	2010-10-8	9年	管华丽先生, GFA, 博士学历, 历任申银万国证券股份有限公司投资部投资经理、高级投资经理, 信银基金管理有限公司分析师、基金经理, 信银基金管理有限公司权益投资总监、基金经理, 公司权益投资总监。

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循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《交银施罗德成长股票证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,基金投资运作符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋取最大利益。

4.3 公平交易专项说明

本公司有严格的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,公平对待旗下所有投资组合。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益差、收益率差、跟踪误差、夏普比率、信息比率以及不同时间窗内(5日内、5日内、10日内)同时交易的交易价格均未发现异常差异。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司有严格的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,公平对待旗下所有投资组合。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益差、收益率差、跟踪误差、夏普比率、信息比率以及不同时间窗内(5日内、5日内、10日内)同时交易的交易价格均未发现异常差异。

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

本基金在报告期内未发现与投资风格相似的投资组合之间的业绩比较。

4.4 管理人对报告期内基金的经营情况的说明

本基金在报告期内未发现异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的经营情况的说明

本基金在报告期内未发现异常交易行为。

4.6 管理人对报告期内基金的经营情况的说明

本基金在报告期内未发现异常交易行为。

4.7 备查文件目录

1.中国证监会准予交银施罗德成长股票证券投资基金募集的文件;

2.交银施罗德成长股票证券投资基金基金合同;

3.交银施罗德成长股票证券投资基金招募说明书;

4.交银施罗德成长股票证券投资基金托管协议;

5.关于募集交银施罗德成长股票证券投资基金的法律意见书;

6.基金托管人业务资格文件、营业执照;

7.基金托管人与基金公司签署的基金托管协议;

8.报告期内交银施罗德成长股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.存放地。

10.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.jyfund.com, www.jsyld.com, www.locomchs.com.cn 查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得书面文件的复印件或复印件。

投资者对本报告如有异议,可向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

服务中心电话:400-700-5000 免长途话费,021-61055000,电子邮件:services@jsyld.com。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)

1.本期已实现收益 1,806,385.46

2.本期利润 1,806,385.46

3.加权平均基金份额本期利润 0.0025

4.期末基金份额净值 5,912,275,355.83

5.期末基金份额总额 2,677,1

6.期末基金资产净值 2,028,442,093.68

7.期末基金份额净值增长率 0.97%

8.期末基金份额净值增长率标准差 0.002%

9.期末基金资产净值增长率相对收益 0.0117%

10.期末基金资产净值增长率相对收益标准差 0.0048%

注:本基金净值收益分配以月度折价份额。

交银施罗德货币市场证券投资基金

份额累计净值收益与业绩比较基准收益率走势对比图

2006年1月1日至2011年6月30日

1.交银货币A

份额净值

份额净值