

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4月20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和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金管理人提示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。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 交银稳健配置混合

基金主代码 519690

交易代码 519690(前端) 519691(后端)

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2006年6月14日

报告期末基金份额总额 3,496,844,298.34份

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

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -210,213,302.48

2.本期利润 111,560,296.92

3.期末平均基金份额本期利润 0.0314

4.期末基金资产净值 4,224,822,618.12

5.期末基金份额净值 1.2052

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，本期利润是指报告期利润减去报告期已实现收益后的余额。

3.期末净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

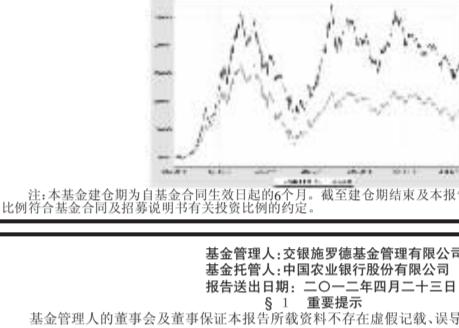
阶段 净值增长 率① 净值增 长率标 准差② 业绩比较基 准收益率③ 半标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 2.59% 1.45% 3.45% 1.01% -0.86% 0.44%

3.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其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业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2006年6月1日至2012年3月31日)



注：本基金建仓期为自基金合同生效之日起的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 管理人报告

报告期内本基金未发生影响投资者决策的重大事件。

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。

基金管理人提示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。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 5 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 采掘业 137,938,635.45 3.26

C 制造业 1,614,342,650.47 38.21

D 食品、饮料 756,130,818.20 17.90

E 纺织、服装、皮毛 - -

F 木材、家具 - -

G 石油、化学、塑胶、塑料 - -

H 电子 - -

I 金属、非金属 - -

J 机械、设备、仪表 323,139,762.61 7.65

K 医药、生物制品 259,939,188.38 6.15

L 其他制造业 43,544,276.64 1.03

M 电力、煤气及水的生产和供应业 - -

E 建筑业 187,131,282.54 4.43

F 交通运输、仓储业 - -

G 信息技术业 114,267,236.16 2.70

H 批发和零售贸易 246,390,228.83 5.83

I 金融、保险业 183,600,303.76 4.35

J 房地产业 876,870,876.56 20.76

K 社会服务业 20,571,876.00 0.49

L 传播与文化产业 - -

M 综合类 - -

合计 3,381,113,089.77 80.03

§ 6 开放式基金份额变动

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 1,990,873.28

2 应收证券清算款 18,719,688.58

3 应收股利 - -

4 应收利息 2,497,158.35

5 应收申购款 327,526.39

6 其他应收款 - -

7 待摊费用 - -

8 其他 - -

9 合计 23,535,246.60

§ 7 备查文件目录

1.中国证监会核准交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金募集的文件；

2.交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金合同；

3.交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金招募说明书；

4.交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金托管协议；

5.关于基金账户开立与变更的公告；

6.基金管理人业务资格批件、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稳健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.基金账户开立与变更的公告；

10.定期报告；

11.如果在报告期内发生转换业务，则总申购份额中包含该业务；

12.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

13.如果在报告期内发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

14.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

15.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

16.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

17.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

18.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

19.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

20.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

21.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

22.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

23.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

24.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

25.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

26.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

27.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

28.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

29.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

30.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

31.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

32.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

33.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

34.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

35.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

36.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

37.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

38.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

39.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

40.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

41.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

42.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

43.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

44.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

45.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

46.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

47.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

48.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

49.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

50.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

51.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

52.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

53.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

54.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

55.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

56.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

57.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

58.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

59.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

60.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

61.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

62.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

63.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

64.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

65.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

66.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

67.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

68.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

69.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

70.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

71.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

72.如果在报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

73.如果在报告期内发生转换入业务，则总申购份额中包含