

交银施罗德先进制造股票证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

18.91%，沪深300指数和业绩比较基准。

上半年本基金仓位保持在中性偏低的水平。国内宏观经济指标整体疲弱，中观行业上亮点不多，整体A股市场疲弱。但由于人民币一直保持相对强势，流动性相对宽松，A股市场结构行情明显，按申万一级行业统计，信息服务、信息设备、电子、医药四个行业涨幅巨大，其他行业普遍疲弱。虽然经历了6月底的流动性冲击，7月初的中报业绩压力测试，结构性的行情走势并未改变，反而有愈演愈烈的迹象。

4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日，本基金份额净值为1.025元，本报告期份额净值增长率为18.91%，同期业绩比较基准增长率为4.65%。

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

下半年预计行业板块间巨大的涨幅差异会有所收敛。在结构转型的背景下，在周期性行业整体景气低迷的衬托下，几个行业景气程度相对较好的行业获得投资者的持续追捧或是可以理解的。但目前市场整体投资逻辑的缺陷在于在宏观假设下的冲突被放大以加剧。如果市场对于周期性行业板块的定价是对的，则预示着宏观条件可能会趋糟糕，在这样的背景下，目前高景气行业的高估值也显得难以持续的。虽然很难判断转折的拐点在哪里，但是这种交易的危险正持续加大。

4.6 管理人对于报告期内本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、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定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贯性。估值委员会的研究部成员投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍采用的做法，建议估值的方法或模型，由受托投资部进行测算和认证，认可后可交估值委员会成员从基金会计、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估，在发生了影响估值政策和程序的有效性及时性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。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、信息披露情况保持有效的专业敏感，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程序各方之间不存在任何重大利益冲突，截止本报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内本基金利润分配情况的说明

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遵规守信情况声明

在托管交银施罗德先进制造股票证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格恪守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金合同》、《交银施罗德先进制造股票证券投资基金托管协议》约定，对交银施罗德先进制造股票证券投资基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司2013年1月1日至2013年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德先进制造股票证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等情况的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人应编制和披露的交银施罗德先进制造股票证券投资基金半年度报告中的财务数据、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部

2013年8月23日

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：交银施罗德先进制造股票证券投资基金

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	196,994,702.59	70,869,294.71
结算备付金			645,128.82
存出保证金		106,846.14	29,249.47
交易性金融资产	6.4.7.2	440,307,852.50	359,520,996.16
其中：股票投资		440,307,852.50	359,520,996.16
基金投资			
债券投资			
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	74,800,432.20	
应收证券清算款			
应收利息	6.4.7.5	109,715.33	16,368.75
应收股利		118,717.72	
应收申购款		1,111,728.42	14,167.97
递延所得税资产			
其他资产	6.4.7.6		
资产总计		713,549,988.90	431,095,205.88
负债和所有者权益	附注号	2013年6月30日	2012年12月31日
负债：			
短期借款			
交易性金融负债			
衍生金融负债	6.4.7.3		
卖出回购金融资产款			
应付证券清算款			6,726,427.67
应付利息		1,025,055.76	714,646.07
应付管理人报酬		886,449.40	504,885.64
应付托管费		147,741.55	84,147.60
应付销售服务费			
应付交易费用	6.4.7.7	130,985.76	318,491.63
应交税费			
应付利息			
应付利润			
递延所得税负债			
负债合计	6.4.7.8	186,493.11	391,818.02
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	693,894,809.56	489,983,870.81
未分配利润	6.4.7.10	17,278,453.76	-67,629,126.56
所有者权益合计		711,173,263.32	422,354,744.25
负债和所有者权益总计		713,549,988.90	431,095,205.88

注：1、报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.025元，基金份额总额693,894,809.56份。

2、本报告中资产负债表附注所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解附注的内容，应查阅完整基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德先进制造股票证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		93,864,024.00	11,707,936.62
1.利息收入		83,367,371.02	84,992,591.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	601,717.33	376,872.20
债券利息收入			
资产支持证券利息收入			
买入返售金融资产收入		235,653.69	472,723.89
其他利息收入			
2.投资收益(损失以“-”填列)	6.4.7.12	45,033,512.03	-40,188,174.79
其中：股票投资收益		42,323,729.61	-42,654,857.14
债券投资收益	6.4.7.13		
资产支持证券投资收益	6.4.7.14		
衍生工具收益	6.4.7.15		
股利收益	6.4.7.16	2,709,782.42	2,466,682.35
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	47,820,233.17	50,921,616.83
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	172,907.78	129,949.49
减：一、费用		6,259,976.08	7,389,986.99
1.管理人报酬		4,610,949.53	3,953,638.20
2.托管费		768,491.61	658,939.67
3.销售服务费			
4.交易费用		683,718.30	2,567,055.26
5.利息支出			
其中：卖出回购金融资产支出			
6.其他费用	6.4.7.20	196,816.64	210,353.86
二、利息收入(亏损总额以“-”号填列)		87,604,047.92	4,317,986.63
三、净利润(净亏损以“-”号填列)		87,604,047.92	4,317,986.63

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：交银施罗德先进制造股票证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	489,983,870.81	-67,629,126.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	87,604,047.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	203,910,938.75	-2,696,467.60
其中：1.基金申购款	450,211,765.37	4,417,517.83
2.基金赎回款	-246,300,826.62	-7,113,985.43
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	693,894,809.56	17,278,453.76

注：1、本报告期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)为87,604,047.92元。

2、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

3、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

4、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

5、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

6、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

7、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

8、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

9、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

10、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

11、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

12、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

13、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

14、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

15、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

16、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

17、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

18、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

19、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

20、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

21、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

22、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

23、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

24、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

25、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

26、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

27、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

28、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

29、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

30、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

31、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

32、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

33、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

34、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

35、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

36、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

37、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

38、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

39、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

40、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

41、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

42、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

43、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

44、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

45、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

46、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

47、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

48、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

49、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

50、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

51、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

52、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

53、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

54、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

55、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

56、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

57、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

58、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

59、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

60、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

61、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

62、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

63、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

64、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

65、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

66、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

67、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

68、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

69、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

70、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

71、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

72、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

73、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

74、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

75、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

76、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

77、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

78、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

79、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

80、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

81、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

82、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

83、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

84、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

85、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

86、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

87、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

88、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

89、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

90、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

91、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

92、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

93、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

94、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

95、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

96、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

97、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

98、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

99、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

100、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

101、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

102、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

103、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

104、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

105、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

106、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

107、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

108、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

109、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

110、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为0元。

111、本报告期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)为