# 交银施罗德信用添利债券证券投资基金

## 【2013】半年度报告摘要

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:二〇一三年八月二十六日

1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下使用全称或其简称"中国农业银行")根据本基金合同规定,于2013年8月23日复核了本报告中的财务指标、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及其更新。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 交银信用添利债券 |
| 基金主代码 | 164902 |
| 交易代码 | 164902 |
| 基金运作方式 | 契约型,本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内,采取封闭式运作(按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外),在深圳证券交易所上市交易,封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2011年1月27日 |
| 基金管理人 | 交银施罗德基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,895,085,749.23份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2011年4月20日 |

注:本基金场内简称为"交银添利"。

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势,自上而下进行宏观分析,自下而上精选个券,在控制信用风险、利率风险和流动性风险前提下,力求通过主动承担适度信用风险获得持续投资收益,谋求基金资产的长期稳定增长。 |
| 投资策略 | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,动态调整大类金融资产比例,自上而下决定债券组合久期及债券类属配置;在严谨深入的信用分析基础上,综合考量信用债券的信用评级,以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选个券。同时,本基金也会关注股票一级市场、权证一级市场等其它相关市场存在的投资机会,力争实现基金总体风险收益特征保持不变前提下的基金资产增值最大化。 |
| 业绩比较基准 | 80%×中债企业债总全价指数收益率+20%×中债国债总全价指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 孙艳 | 李芳菲 |
| | 联系电话 | 021-61055050 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com | lifangfei@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-5000,021-61055000 | 95599 |
| 传真 | | 021-61055054 | 010-63201816 |

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 | www.jyfund.com,www.jysld.com,www.bocomschroder.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

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

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2013年1月1日至2013年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 59,774,168.02 |
| 本期利润 | 59,771,809.40 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0315 |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.93% |
| 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 | 0.054 |
| 期末基金资产净值 | 2,016,987,528.42 |
| 期末基金份额净值 | 1.064 |

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。

3.2 基金净值表现

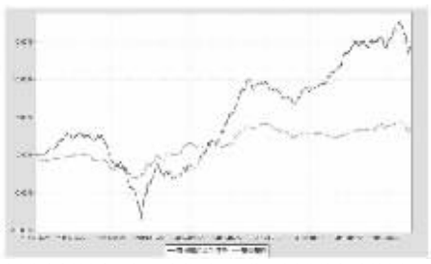
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 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 | -2.39% | 0.35% | -0.61% | 0.18% | -1.78% | 0.17% |
| 过去三个月 | -0.28% | 0.29% | 0.35% | 0.12% | -0.63% | 0.17% |
| 过去六个月 | 2.93% | 0.25% | 1.32% | 0.09% | 1.61% | 0.16% |
| 过去一年 | 5.17% | 0.21% | 0.09% | 0.07% | 5.08% | 0.14% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.64% | 0.24% | 3.73% | 0.09% | 10.91% | 0.15% |

注:本基金的业绩比较基准为80%×中债企业债总全价指数收益率+20%×中债国债总全价指数收益率,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

交银施罗德信用添利债券证券投资基金
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
(2011年1月27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的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字[2005]128号文批准,于2005年8月4日成立的合资基金管理公司。公司总部设于上海,注册资本为2亿元人民币。截止到2013年6月30日,公司已经发行并管理的基金共有二十八只: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(基金合同生效日:2009年9月25日)、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(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)、交银施罗德趋势优先股票证券投资基金(基金合同生效日:2010年12月22日)、交银施罗德信用添利债券证券投资基金(基金合同生效日:2011年1月27日)、交银施罗德先进制造股票证券投资基金(基金合同生效日:2011年6月22日)、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金(基金合同生效日:2011年9月22日)、交银施罗德双利债券证券投资基金(基金合同生效日:2011年9月26日)、交银施罗德深证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)、交银施罗德荣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心股票型证券投资基金(基金合同生效日:2012年8月3日)、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金(基金合同生效日:2012年11月5日)、交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金(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天债券型证券投资基金(基金合同生效日:2013年3月13日)、交银施罗德双轮动债券型证券投资基金(基金合同生效日:2013年4月18日)、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金(基金合同生效日:2013年4月24日)和交银施罗德成长30股票型证券投资基金(基金合同生效日:2013年6月5日)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 林洪钧 | 本基金、交银货币、交银理财21天债券的基金经理,交银荣安保本混合、交银荣祥保本混合的基金经理助理,公司固定收益部助理总经理 | 2011-01-27 | - | 9年 | 林洪钧先生,复旦大学学士。历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理,华安基金管理有限公司债券交易员,加拿大Financial Engineering Source Inc.金融研究员。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任专户投资部投资经理助理、专户投资经理。 |

注:1、本表所列基金经理(助理)任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告(如适用)之日为准;

2、本表所列基金经理(助理)证券从业年限中的"证券从业"的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内,本基金整体运作合规合法,无不当内幕交易和关联交易,基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定,未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易,遵循"时间优先、价格优先、比例分配"的原则,全部通过交易系统进行比例分配;对于非集中竞价交易,以公司名义进行的场外交易,遵循"价格优先、比例分配"的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控,风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司管理的所有投资组合未发生参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年上半年度,我国经济整体复苏力度偏弱,通胀数据也低于市场预期,货币政策整体偏紧。在经济整体弱复苏背景下,市场对宏观的乐观预期逐渐转弱,债券市场在一、二季度整体呈现震荡上涨态势,收益率曲线平坦化下移,但在4月份及6月份经历了两次基本面因素之外的扰动。4月份,银行间债券市场监管风暴使得中长端债券供给大量增加,收益率一度大幅上行,在理财市场逐渐回归理性之后,债市的运行脉络重回基本面上,收益率继续下行;6月份端午之后,流动性成为债券市场唯一关注的指标。全市场范围内的流动性紧张始于外汇占款持续下降,在对央行投放流动性的预期不断落空的情况下,银行间货币市场流动性紧张逐渐达到了较为极端的状态,出现了6月20日30%的隔夜回购利率。货币市场利率飙升表明了央行对之前银行表外业务扩张的强约束态度和提高金融机构风险防范意识的决心。6月25日,在央行发布报告《合理调节流动性 维护货币市场稳定》之后,市场流动性逐步恢复正常,债市的表现也逐渐平稳。

信用债方面,由于信用利差已处于历史低位,本基金在二季度逐步降低组合中低评级持仓,逐步增加AAA评级短融中票的配置;另一方面,由于三年封闭期逐渐临近,且目前债券市场的期限利差也处于历史低位,组合进一步降低组合久期;同时组合保持一定转债的中性仓位。

4.4.2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1.064元,本报告期份额净值增长率为2.93%,同期业绩比较基准增长率为1.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,在外汇占款持续减少、人民币贬值预期不断加强的背景下,央行降息的可能性或不大,货币政策可能仍将维持中性的态度;同时市场对流动性和风险的担忧使得市场预期将比实际情况更紧些。本基金或将进一步延续二季度操作思路,争取为基金持有人创造较稳健的收益。

4.6 管理人对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部、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按投资品种的不同性质,研究并参考市场普遍认同的做法,建议合理的估值模型,由量化投资部进行测算和认证,认可后交各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价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后,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 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,根据相关法律法规和基金合同要求,本基金对上一年度应分配的可分配利润进行了一次收益分配,具体情况参见半年度报告正文6.4.11利润分配情况。

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

在托管交银施罗德信用添利债券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遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金合同》、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金托管协议》的约定,对交银施罗德信用添利债券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,认真履行了托管人的义务,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信用添利债券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内容的真实、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,基金管理人所编制和披露的交银施罗德信用添利债券证券投资基金半年度报告中的财务指标、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:交银施罗德信用添利债券证券投资基金
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 | 15,093,648.93 | 1,616,455.09 |
| 结算备付金 | | 50,550,476.24 | 62,447,721.95 |
| 存出保证金 | | 272,584.54 | 5,507.50 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,890,249,376.50 | 2,816,089,402.00 |
| 其中:股票投资 | | 15,350,000.00 | 32,889,237.30 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 2,868,819,376.50 | 2,767,294,164.70 |
| 资产支持证券投资 | | 6,080,000.00 | 15,906,000.00 |
| 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 | | 21,296,519.18 | 8,643,313.00 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 49,899,083.45 | 58,689,289.47 |
| 应收股利 | | 49,875.00 | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 3,027,411,563.84 | 2,947,491,689.01 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 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 | | 1,003,797,921.90 | 896,498,552.65 |
| 应付证券清算款 | | - | 17,502.05 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,004,669.03 | 1,031,386.60 |
| 应付托管费 | | 334,889.68 | 343,795.57 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 51,361.82 | 47,725.41 |
| 应交税费 | | 4,303,690.68 | 4,297,768.45 |
| 应付利息 | | 722,733.29 | 484,293.24 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 208,769.02 | 381,000.00 |
| 负债合计 | | 1,010,424,035.42 | 903,102,023.97 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,895,085,749.23 | 1,895,085,749.23 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 121,901,779.19 | 149,303,915.81 |
| 所有者权益合计 | | 2,016,987,528.42 | 2,044,389,665.04 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,027,411,563.84 | 2,947,491,689.01 |

注:1、报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.064元,基金份额总额1,895,085,749.23份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2利润表

会计主体:交银施罗德信用添利债券证券投资基金
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 | | 89,059,175.65 | 251,844,602.25 |
| 1.利息收入 | | 71,449,966.33 | 91,675,831.08 |
| 其中:存款利息收入 | 6.4.7.11 | 584,728.77 | 666,825.82 |
| 债券利息收入 | | 70,684,162.91 | 91,009,005.26 |
| 资产支持证券利息收入 | | 162,436.15 | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 18,638.50 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | 17,611,567.94 | 14,474,886.70 |
| 其中:股票投资收益 | 6.4.7.12 | -16,278,954.08 | -3,993,044.23 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 33,618,942.64 | 18,271,949.63 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.14 | 58,549.38 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 213,030.00 | 195,981.30 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 6.4.7.17 | -2,358.62 | 145,693,884.47 |
| 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 | - | - |
| 减:二、费用 | | 29,287,366.25 | 32,949,227.97 |
| 1.管理人报酬 | | 6,034,812.85 | 5,810,864.65 |
| 2.托管费 | | 2,011,604.28 | 1,936,954.89 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | 6.4.7.19 | 93,586.23 | 220,755.88 |
| 5.利息支出 | | 20,606,446.92 | 24,519,303.45 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 20,606,446.92 | 24,519,303.45 |
| 6.其他费用 | 6.4.7.20 | 540,915.97 | 461,349.10 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | 59,771,809.40 | 218,895,374.28 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | 59,771,809.40 | 218,895,374.28 |

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德信用添利债券证券投资基金
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 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,895,085,749.23 | 149,303,915.81 | 2,044,389,665.04 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 59,771,809.40 | 59,771,809.40 |
| 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) | - | - | - |
| 其中:1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 四、本期向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) | - | -87,173,946.02 | -87,173,946.02 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,895,085,749.23 | 121,901,779.19 | 2,016,987,528.42 |
| 项目 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,895,085,749.23 | -48,020,542.45 | 1,847,065,206.78 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 218,895,374.28 | 218,895,374.28 |
| 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) | - | - | - |
| 其中:1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 四、本期向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) | - | -64,432,918.84 | -64,432,918.84 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,895,085,749.23 | 106,441,912.99 | 2,001,527,662.22 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:战龙,主管会计工作负责人:许珊燕,会计机构负责人:朱鸣

6.4报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德信用添利债券证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2010]第1601号《关于核准交银施罗德信用添利债券证券投资基金募集的批复》核准,由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金,在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内,采取封闭式运作(按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外),在深圳证券交易所上市交易,封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF),存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,894,760,542.88元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2011)第13号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金合同》于2011年1月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,895,085,749.23份基金份额,其中认购资金利息折合325,206.35份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、招募说明书及其定期更新的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,主要投资于固定收益类资产,包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券及可分离转债、资产支持证券、次级债和债券回购等金融工具。本基金可同时投资于股票、权证等权益类产品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类金融工具,但可以参与一级市场股票首次公开发行或新股增发,并可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于分离交易可转债而产生的权证。本基金的投资组合比例为:在封闭期内,对债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中对信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的80%;对股票、权证等非固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的20%。在开放期内,对债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中对信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的80%;对股票、权证等非固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的20%;其中现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中债企业债总全价指数收益率×80%+中债国债总全价指数收益率×20%

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年6月30日的财务状况以及2013年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。2013年1月1日以前,对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 交银施罗德基金管理有限公司("交银施罗德基金公司") | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司("中国农业银行") | 基金托管人、基金代销机构 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

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 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,034,812.85 | 5,810,864.65 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 641,799.58 | 644,332.59 |

注:支付基金管理人交银施罗德基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

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 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,011,604.28 | 1,936,954.89 |

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.8.2.3销售服务费

无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

| 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| - | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国农业银行 | - | 50,298,838.59 | - | - | - | - |

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 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 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 15,093,648.93 | 148,666.04 | 34,271,242.96 | 122,790.56 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

| 6.4.9.1.1 受限证券类别:股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 002106 | 莱宝高科 | 2013-03-18 | 2014-03-19 | 非公开发行 | 16.52 | 15.35 | 1,000,000 | 16,520,000.00 | 15,350,000.00 | - |
| 6.4.9.1.2 受限证券类别:债券 | | | | | | | | | | |
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 112172 | 13普邦债 | 2013-05-14 | 2013-07-12 | 分销 | 100.00 | 100.00 | 100,000 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |

注:莱宝高科2012年年度权益分派方案为:10派1.5元(含税),利润分配股权登记日:2013-6-5,利润分配除权除息日:2013-6-6。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额548,797,976.80元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1382177 | 13沙钢MTN1 | 2013-07-01 | 99.84 | 1,000,000 | 99,840,000.00 |
| 1182334 | 11滨海建MTN1 | 2013-07-02 | 101.73 | 1,000,000 | 101,730,000.00 |
| 1080046 | 10内蒙高新债 | 2013-07-02 | 102.03 | 500,000 | 51,015,000.00 |
| 1382159 | 13鞍钢MTN1 | 2013-07-01 | 99.28 | 500,000 | 49,640,000.00 |
| 1382159 | 13鞍钢MTN1 | 2013-07-03 | 99.28 | 200,000 | 19,856,000.00 |
| 1282385 | 12冀中MTN1 | 2013-07-03 | 101.