

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年八月二十六日
1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不存在虚假记载、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。本半年度报告已于三分之二以上独立董事签字同意,并由董事签字发表。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下使用全称或其简称“中国工商银行”)根据基金合同规定,于2013年8月25日复核了本报告中财务资料、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表示其未来表现。投资者有风险,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,投资者想了解详细内容,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

基金名称	交银优势行业混合
基金主代码	519097
交易代码	519097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年11月21日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	264,468,625.05份
报告期末基金份额持有人户数	不定期

2.2 基金产品说明
根据宏观经济周期和市场环境的变化,自上而下灵活配置资产,积极把握行业发展趋势和行业景气轮动中蕴含的投资机会,在控制风险并保持良好的流动性的前提下,力求实现基金资产的长期增值。
本基金为基金管理人研究优势、择时能力强、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,自上而下灵活配置资产,通过把握和判断行业景气度及行业景气程度变化,挖掘预期具有良好增长前景的优势行业,精选个股,以求谋求超额收益。

业绩比较基准 60%×沪深300指数收益率+40%×中债富时国债指数收益率
风险收益特征 本基金是一只灵活配置的混合型基金,属于基金中的较高风险品种,风险与预期收益高于股票型基金和债券型基金之间。

2.3 基金管理人基本情况	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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 曹建 联系电话 021-61055050 电子邮箱 xspj@yjsd.com, disclosure@yjsd.com	姓名 曹建 联系电话 010-61050799 电子邮箱 custserv@icbc.com.cn
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	95588
传真	021-61055054	010-66105798

2.4 信息披露方式
登载基金半年度报告正文的
基金管理人互联网网站
基金半年度报告备置地点 基金管理人办公场所

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期末(2013年1月1日至2013年6月30日)	金额单位:人民币元
本期已实现收益	21,884,591.23	
本期利润	13,426,489.02	
加权平均基金份额本期利润	0.0459	
本期基金份额净值增长率	0.549%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	金额单位:人民币元
期末基金份额净值	0.068	
期末基金份额净值增长率	282,452,026.83	
期末基金份额净值增长率	1,068.36	

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不低于下列所列数字。
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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准偏差③	①-②	②-④
过去一个月	-8.17%	1.53%	-9.68%	1.14%	1.51%
过去三个月	0.28%	1.22%	-6.76%	0.88%	7.04%
过去六个月	3.59%	1.14%	-6.63%	0.91%	10.22%
过去一年	-2.62%	1.00%	-4.61%	0.83%	1.99%
自基金转型起至今	1.09%	0.90%	-4.10%	0.79%	0.11%

注:交银施罗德保本混合证券投资基金自2012年2月31日起正式转型为交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金,本表列示的基金业绩转型后的基金净值表现,转型后基金的业绩比较基准为60%×沪深300指数收益率+40%×中债富时国债指数收益率,每日进行再平衡计算。

3.2.2 自基金转型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

交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金 份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2012年2月3日至2013年6月30日)

注:1、本报告截止2013年6月30日,基金份额净值1.068元,基金份额总额264,468,625.05份;
2、本报告期内资产净值变动表附列附注3为半年度报告正文中对应的附注3,投资者想了解详细附注的内容,应查阅基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 财务报表
会计主体:交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

注:1、本报告截止2013年6月30日,基金份额净值1.068元,基金份额总额264,468,625.05份;
2、本报告期内资产净值变动表附列附注3为半年度报告正文中对应的附注3,投资者想了解详细附注的内容,应查阅基金管理人网站的半年度报告正文。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注3	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年2月3日至2012年6月30日
一、收入		18,094,707.19	25,930,133.46
1.利息收入		3,154,835.27	6,847,258.57
其中:存款利息收入	6.4.7.1.1	42,109.11	66,334.43
债券利息收入		3,104,665.22	6,480,690.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,060.94	270,233.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		23,395,102.96	12,319,046.01
其中:股票投资收益	6.4.7.1.2	21,763,955.06	8,654,103.67
二、费用		-143,893.91	-2,042,221.66
1.销售服务费	6.4.7.1.3	-	-
2.托管费	6.4.7.1.4	-	-
3.销售服务费	6.4.7.1.5	-	-
4.交易费用	6.4.7.1.6	1,029,602.20	863,229.32
5.利息支出		677,411.11	1,040,610.73
其中:卖出回购金融资产支出		677,411.11	1,140,610.73
6.其他费用	6.4.7.1.7	200,882.64	173,419.76
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		13,426,489.02	18,487,795.48
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		13,426,489.02	18,487,795.48

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注3	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年2月3日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		325,213,412.69	16,461,142.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)		-	13,426,489.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)		-60,744,787.64	-5,511,092.71
其中:1.基金申购款		2,575,155.40	264,757.08
2.基金赎回款		-63,319,943.04	-5,757,849.79
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)		-	-6,393,136.63
五、期末所有者权益(基金净值)		264,468,625.05	17,983,401.78

注:1、本表附列基金净值表现(净值)在招募说明书中披露。
2、本表附列基金净值表现(净值)在招募说明书中披露。
3、本表附列基金净值表现(净值)在招募说明书中披露。

4.2 管理人报告
4.2.1 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.2 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.3 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.4 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.5 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.6 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.7 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.8 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.9 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.10 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.11 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.12 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.13 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.14 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.15 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.16 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.17 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

4.2.18 基金管理人及基金管理人简介
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金

2013 半年度报告摘要

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致性。估值委员会的构成和估值政策和程序的不确定性,研究并参考市场普遍认同的估值方法,建议合理的估值模型,由估值委员会进行测算和认定,认可后各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审核,一致同意后,报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期评估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时性的情况下,及时召开估值委员会进行研究和讨论,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,基金估值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。基金管理人参与估值流程职责之不存在任何重大利益冲突,相关估值结果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资产净值变动的说明
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利润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。

5.1 报告期内本基金托管人遵守情况
本报告期内,本基金托管人严格按照相关法律法规和基金合同的要求,不存在任何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
本报告期内交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金的管理人——交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金估值核算等方面恪尽职守,基金估值计算等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各项业务过程中均严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额76,393,136.63元。

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
本托管人依法对交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金估值核算等方面恪尽职守,基金估值计算等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各项业务过程中均严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额76,393,136.63元。

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:交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2013年6月30日

资产	附注3	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
货币资金	6.4.7.1	2,537,358.34	5,037,357.89
结算备付金		1,007,542.26	641,253.05
存出保证金		184,261.69	690,803.36
交易性金融资产	6.4.7.2	305,061,750.67	373,489,947.99
其中:股票投资		196,702,268.52	250,759,388.38
基金投资		-	-
债券投资		108,359,482.15	122,910,559.61
资产支持证券投资		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-	-
应收证券清算款	6.4.7.4	12,992,140.81	8,000,000.00
应收利息	6.4.7.5	2,533,111.83	2,001,612.23
应收股利		-	-
应收申购款		10,840.36	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	390,660,974.52	-
资产总计		324,327,006.16	390,660,974.52

负债和所有者权益
附注3

负债	附注3	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
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		25,000,000.00	43,799,715.30
应付证券清算款		13,476,864.25	402,448.50
应付赎回款		367,426.47	415,083.11
应付管理人报酬		61,237.74	69,175.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	229,672.93	253,931.09
应交税费		2,101,890.73	2,101,889.64
应付利息		6,517.26	49,207.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	185,597.19	1,895,000.00
负债合计		41,874,979.33	48,986,419.73
所有者权益		-	-
实收基金	6.4.7.9	264,468,625.05	325,213,412.69
未分配利润	6.4.7.10	17,983,401.78	16,461,142.10
所有者权益合计		282,452,026.83	341,674,554.79
负债和所有者权益总计		324,327,006.16	390,660,974.52

注:1、本报告截止2013年6月30日,基金份额净值1.068元,基金份额总额264,468,625.05份;
2、本报告期内资产净值变动表附列附注3为半年度报告正文中对应的附注3,投资者想了解详细附注的内容,应查阅基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 财务报表
会计主体:交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注3	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年2月3日至2012年6月30日
一、收入		18,094,707.19	25,930,133.46
1.利息收入		3,154,835.27	6,847,258.57
其中:存款利息收入	6.4.7.1.1	42,109.11	66,334.43
债券利息收入		3,104,665.22	6,480,690.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,060.94	270,233.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		23,395,102.96	12,319,046.01
其中:股票投资收益	6.4.7.1.2	21,763,955.06	8,654,103.67
二、费用		-143,893.91	-2,042,221.66
1.销售服务费	6.4.7.1.3	-	-
2.托管费	6.4.7.1.4	-	-
3.销售服务费	6.4.7.1.5	-	-
4.交易费用	6.4.7.1.6	1,029,602.20	863,229.32
5.利息支出		677,411.11	1,040,610.73
其中:卖出回购金融资产支出		677,411.11	1,140,610.73
6.其他费用	6.4.7.1.7	200,882.64	173,419.76
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		13,426,489.02	18,487,795.48
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		13,426,489.02	18,487,795.48

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注3	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年2月3日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		325,213,412.69	16,461,142.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)		-	13,426,489.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)		-60,744,787.64	-5,511,092.71
其中:1.基金申购款		2,575,155.40	264,757.08
2.基金赎回款		-63,319,943.04	-5,757,849.79
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)		-	-6,393,136.63
五、期末所有者权益(基金净值)		264,468,625.05	17,983,401.78

注:1、本报告截止2013年6月30日,基金份额净值1.068元,基金份额总额264,468,625.05份;
2、本报告期内资产净值变动表附列附注3为半年度报告正文中对应的附注3,投资者想了解详细附注的内容,应查阅基金管理人网站的半年度报告正文。

6.4 财务报表
会计主体:交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注3	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年2月3日至2012年6月30日
一、收入		18,094,707.19	25,930,133.46
1.利息收入		3,154,835.27	6,847,258.57
其中:存款利息收入	6.4.7.1.1	42,109.11	66,334.43
债券利息收入		3,104,665.22	6,480,690.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,060.94	270,233.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		23,395,102.96	12,319,046.01
其中:股票投资收益	6.4.7.1.2	21,763,955.06	8,654,103.67
二、费用		-143,893.91	-2,042,221.66
1.销售服务费	6.4.7.1.3	-	-
2.托管费	6.4.7.1.4	-	-
3.销售服务费	6.4.7.1.5	-	-
4.交易费用	6.4.7.1.6	1,029,602.20	863,229.32
5.利息支出		677,411.11	1,040,610.73
其中:卖出回购金融资产支出		677,411.11	1,140,610.73
6.其他费用	6.4.7.1.7	200,882.64	173,419.76
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		13,426,489.02	18,487,795.48
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		13,426,489.02	18,487,795.48

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注3	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年2月3日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		325,213,412.69	16,461,142.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)		-	13,426,489.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)		-60,744,787.64	-5,511,092.71
其中:1.基金申购款		2,575,155.40	264,757.08
2.基金赎回款		-63,319,943.04	-5,757,849.79
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)		-	-6,393,136.63
五、期末所有者权益(基金净值)		264,468,625.05	17,983,401.78

注:1、本报告截止2013年6月30日,基金份额净值1.068元,基金份额总额264,468,625.05份;
2、本报告期内资产净值变动表附列附注3为半年度报告正文中对应的附注3,投资者想了解详细附注的内容,应查阅基金管理人网站的半年度报告正文。

6.4 财务报表
会计主体:交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注3	本期 2013年
----	-----	-------------