

交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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 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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本报告期内基金投资信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人复核审查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。

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:交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

资产	附注3	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币			
银行存款	6.4.7.1	111,120,559.68	307,797,230.34
结算备付金		3,852,647.45	10,924,021.78
交易性金融资产		899,145.80	1,207,241.24
其中:股票投资	6.4.7.2	2,286,116,236.64	3,392,607,271.48
其中:债券投资		2,154,804,396.64	3,292,422,271.48
银行存款		131,311,840.00	99,585,000.00
资产支持证券		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	446,083,982.00	396,130,697.61
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,799,489.59	2,859,338.68
应收股利		-	-
应收申购款		154,153.57	300,672,543.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,853,026,214.73	4,411,599,443.73
负债和所有者权益	附注3		
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款	6.4.7.3	-	-
应付短期融资券		-	-
应付证券清算款		-	-
应付利息		3,683,529.02	3,647,138.01
应付管理人报酬		3,434,662.31	4,973,235.93
应付托管费		572,443.74	828,672.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,794,891.53	3,537,241.62
应交税费		985,200.00	985,200.00
应付利息		-	-
应付股利		-	-
预提费用		-	-
应付债券		-	-
其他应付款	6.4.7.8	201,824.46	402,850.33
负债合计		10,672,561.96	183,125,443.85
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	2,742,122,099.83	3,701,256,292.99
未分配利润	6.4.7.10	100,231,552.94	527,217,716.89
所有者权益合计		2,842,353,652.77	4,228,474,009.88
负债和所有者权益总计		2,853,026,214.73	4,411,599,443.73

注:1、报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0366元,基金份额总额2,742,122,099.83份。
2、本报告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,投资者想了解附注的内容,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:交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注3	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		-306,752,540.04	-113,899,315.59
1.利息收入		4,539,676.83	9,575,891.40
其中:存款利息收入	6.4.7.11	4,511,851.63	3,161,908.96
债券利息收入		1,965,768.12	717,252.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,891,077.08	5,696,729.99
其他利息收入		-	-
2.股息收入		-	-
其中:股票股息收入(“股利”)		-169,974,942.48	486,221,841.88
债券股息收入(“股利”)	6.4.7.12	-187,106,115.45	480,940,337.02
基金投资收益		-	-
3.公允价值变动收益	6.4.7.13	8,350.00	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
投资收益	6.4.7.16	17,122,862.27	35,381,734.56
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-142,433,791.07	-560,773,441.80
4.其他收入(损失以“-”号填列)		1,116,476.38	1,116,303.23
其中:公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		37,952,578.54	51,967,447.27
二、费用		-2,792,927.35	-31,770,247.31
1.管理人报酬		4,129,487.91	5,295,117.86
2.托管费		-	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	8,826,329.50	14,697,999.34
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
其他费用	6.4.7.20	219,833.38	223,621.91
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-344,765,118.58	-165,846,762.86
减:所得税费用		-	-
净利润(净亏损以“-”号填列)		-344,765,118.58	-165,846,762.86

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	3,701,256,292.99	3,272,716,891.48
二、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	-	-344,765,118.58
三、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	-959,134,193.16	-82,281,045.37
四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	91,570,621.00	8,750,621.00
五、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	-1,050,704,876.54	-91,038,715.58
六、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	2,742,122,099.83	100,231,552.94
七、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	3,467,828,029.01	1,280,623,953.99
八、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	-	-165,846,762.86
九、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	20,946,899.24	-135,074,666.58
十、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	880,349,887.02	228,544,423.89
十一、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	-1,036,370,852.84	-207,597,524.63
十二、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	-	-680,462,386.83
十三、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	3,311,807,063.19	415,264,703.54
十四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列)	-	3,727,668,763.73

报表附注为财务报表的重要组成部分。
本报告人166人,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:许珊珊,会计机构负责人:宋鸣

6.4 财务报表

交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金(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”)证监基金字[2006]第78号《关于同意交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金募集申请的批复》核准,由交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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7,011,427,454.90元,经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第73号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金基金合同》于2006年6月14日正式生效,基金合同生效日至本报告期末基金份额总额为7,016,138,522.08份基金份额,其中认购资金利息折合4,711,067,189.03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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的基金托管人具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币、基金、短期金融工具、权证、资产支持证券及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产净值的35%-95%;债券资产占基金资产净值的5%-60%;现金、短期金融工具、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的5%-65%,其中基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的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:65%×MSCI中国A股指数+35%×中信标普全债指数。

6.4.2 会计政策的编制基础

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》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”)、中国证券监督管理委员会的《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》、《交银施罗德稳健配置混合型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事项
本基金2014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2014年6月30日的财务状况以及2014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保持一致的说明
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
本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 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。

6.4.6.6 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。

6.4.6.7 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。

6.4.6.8 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。

6.4.6.9 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。

6.4.6.10 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。

6.4.6.11 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。

6.4.6.12 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。

6.4.6.13 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。

6.4.6.14 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。

6.4.6.15 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。

6.4.6.16 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。

6.4.6.17 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。

6.4.6.18 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。

6.4.6.19 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。

6.4.6.20 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。

6.4.6.21 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。

6.4.6.22 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。

6.4.6.23 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。

6.4.6.24 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。

6.4.6.25 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。

6.4.6.26 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。

6.4.6.27 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。

6.4.6.28 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。

6.4.6.29 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。

6.4.6.30 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。

6.4.6.31 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。

6.4.6.32 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。

6.4.6.33 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。

6.4.6.34 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。

6.4.6.35 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。

6.4.6.36 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。

6.4.6.37 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。

6.4.6.38 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。

6.4.6.39 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。

6.4.6.40 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。

6.4.6.41 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。

6.4.6.42 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。

6.4.6.43 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。

6.4.6.44 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。

6.4.6.45 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。

6.4.6.46 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。

6.4.6.47 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。

6.4.6.48 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。

6.4.6.49 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。

6.4.6.50 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。

6.4.6.51 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。

6.4.6.52 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。

6.4.6.53 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。

6.4.6.54 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。

6.4.6.55 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。

6.4.6.56 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。

6.4.6.57 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。

6.4.6.58 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。

6.4.6.59 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。

6.4.6.60 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。

6.4.6.61 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。

6.4.6.62 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。

6.4.6.63 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。

6.4.6.64 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。

6.4.6.65 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。

6.4.6.66 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。

6.4.6.67 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。

6.4.6.68 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。

6.4.6.69 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。

6.4.6.70 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。

6.4.6.71 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。

6.4.6.72 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。

6.4.6.73 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。

6.4.6.74 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。

6.4.6.75 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。

6.4.6.76 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。

6.4.6.77 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。

6.4.6.78 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。

6.4.6.79 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。

6.4.6.80 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。

6.4.6.81 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。

6.4.6.82 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。

6.4.6.83 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。

6.4.6.84 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。

6.4.6.85 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。

6.4.6.86 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。

6.4.6.87 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。

6.4.6.88 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。

6.4.6.89 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。

6.4.6.90 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。

6.4.6.91 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。