

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
报告送出日期:二〇一四年八月二十五日

§ 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。本基金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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)根据本基金合同规定，于2014年8月22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信勤勉、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摘要。

本半年度报告摘要自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银施罗德稳健配置混合
基金代码	519690
交易币种	人民币
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
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
报告期末基金总资产	2,742,122,999.83元
基金份额持有人数	不适用

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将保持并不断优化投资的基本配置，充分考虑市场变化、管理能力、根据市场情况调整股票和债券的比例，从而获取长期稳定的收益。
投资策略	把握宏观经济和市场的变化趋势，根据经济周期理论动态调整投资组合比例，自上而下地分析股票和债券的配置比例，通过定期评估和调整，实现资产的保值增值。
业绩比较基准	65%×MSCI中国A股指数+35%×中信标普全债指数
风险收益特征	本基金是一只风险较低的基金，属于中等风险品种，本基金的风险与预期收益水平低于股票基金和货币基金之间。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	孙艳	田青
联系电话	021-61055050	010-67595096
电子邮箱	xsypl@jydd.com;disclosure@jydd.com	tumeng@bjcb.com
客户服务电话	400-700-5000;021-61055000	010-67595096
传真	021-61055054	010-66275883

2.4 报价披露方式

基金管理人及相关网站	www.fund901.com, www.bocomchroder.com
基金管理人办公地址	基金管理人办公地址

§ 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(2014年1月1日至2014年6月30日)	
本期已实现收益	-	-20,271,327.51	
本期利润	-	-344,705,118.58	
加权平均基金份额本期利润	-	-0.10%	
本期基金份额净值增长率	-	-9.26%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)		
期末可供分配基金份额	0.0366		
期末基金资产净值	2,842,353,652.77		
期末基金净值	1.0366		

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

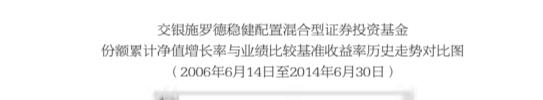
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 准收益率差 额③	①-③	②-④
过去一个月	3.31%	0.86%	0.72%	0.52%	0.34%
过去一个季度	4.50%	1.02%	1.34%	0.58%	0.34%
过去六个月	-9.26%	-2.06%	-2.65%	-0.61%	0.52%
过去一年	-7.89%	1.14%	2.16%	0.76%	-10.05%
过去三年	-11.46%	1.11%	-13.98%	0.84%	2.52%
自基金合同生效以来	158.78%	1.57%	72.92%	1.22%	85.86%

注:1.本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由“65% × MSCI中国A股指数+35% × 新华巴克莱中国国债指数”变更为“65% × MSCI中国A股指数+35% × 中信标普全债指数”,3.2.2项。详情见本基金管理人于2013年6月14日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同中相关内容的公告》。

2.本基金的业绩比较基准每日进行平行更新。

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



注:1.本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由“65% × MSCI中国A股指数+35% × 新华巴克莱中国国债指数”变更为“65% × MSCI中国A股指数+35% × 中信标普全债指数”,3.2.2项。详情见本基金管理人于2013年6月14日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同中相关内容的公告》。

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。

3.2.3 基金净值表现

3.2.4 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 准收益率差 额③	①-③	②-④
过去一个月	3.31%	0.86%	0.72%	0.52%	0.34%
过去一个季度	4.50%	1.02%	1.34%	0.58%	0.34%
过去六个月	-9.26%	-2.06%	-2.65%	-0.61%	0.52%
过去一年	-7.89%	1.14%	2.16%	0.76%	-10.05%
过去三年	-11.46%	1.11%	-13.98%	0.84%	2.52%
自基金合同生效以来	158.78%	1.57%	72.92%	1.22%	85.86%

注:1.本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由“65% × MSCI中国A股指数+35% × 新华巴克莱中国国债指数”变更为“65% × MSCI中国A股指数+35% × 中信标普全债指数”,3.2.2项。详情见本基金管理人于2013年6月14日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同中相关内容的公告》。

2.本基金的业绩比较基准每日进行平行更新。

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



注:1.本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由“65% × MSCI中国A股指数+35% × 新华巴克莱中国国债指数”变更为“65% × MSCI中国A股指数+35% × 中信标普全债指数”,3.2.2项。详情见本基金管理人于2013年6月14日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同中相关内容的公告》。

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。

3.2.3 基金净值表现

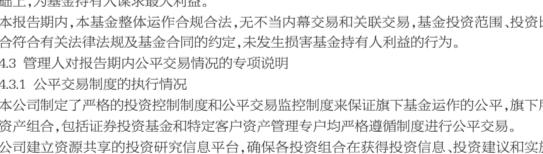
3.2.4 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 准收益率差 额③	①-③	②-④
过去一个月	3.31%	0.86%	0.72%	0.52%	0.34%
过去一个季度	4.50%	1.02%	1.34%	0.58%	0.34%
过去六个月	-9.26%	-2.06%	-2.65%	-0.61%	0.52%
过去一年	-7.89%	1.14%	2.16%	0.76%	-10.05%
过去三年	-11.46%	1.11%	-13.98%	0.84%	2.52%
自基金合同生效以来	158.78%	1.57%	72.92%	1.22%	85.86%

注:1.本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由“65% × MSCI中国A股指数+35% × 新华巴克莱中国国债指数”变更为“65% × MSCI中国A股指数+35% × 中信标普全债指数”,3.2.2项。详情见本基金管理人于2013年6月14日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同中相关内容的公告》。

2.本基金的业绩比较基准每日进行平行更新。

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



注:1.本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由“65% × MSCI中国A股指数+35% × 新华巴克莱中国国债指数”变更为“65% × MSCI中国A股指数+35% × 中信标普全债指数”,3.2.2项。详情见本基金管理人于2013年6月14日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同中相关内容的公告》。

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。

3.2.3 基金净值表现

3.2.4 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