

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金名称:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年八月二十四日

重要提示

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本基金的投资运作过程中,严格遵守法律法规,恪守职业道德,勤勉尽责,诚实信用,公平对待投资者,维护基金份额持有人的合法权益,保障基金资产的完整、安全和增值,并依法承担相应的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事同意,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2011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,投资者在做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。
本报告同时符合中国证监会规定。
本报告自2011年7月1日起至6月30日止。

2 基金简介

基金名称	交银施罗德股票
基金代码	519004
交易代码	519004 (前端) 519005 (后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月8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
报告期末基金份额总额	12,793,143,283.32份
基金合同存续期	不定期
2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金为一只蓝筹股票基金,主要通过投资于业绩优良、发展稳定,在行业内具有支配地位、分红稳定的蓝筹上市公司股票,在有效控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,追求在稳定分红的基础上实现基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金充分发掘基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的研究方法与积极主动的投资风格相结合,通过优选绩优、发展稳定,在行业内具有支配地位、分红稳定的蓝筹上市公司股票进行投资,追求基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	75%×中证100指数+25%×中信全债指数
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,以优质蓝筹股为主要投资对象,属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险的品种,本基金的风险与预期收益都高于混合型基金和债券型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人	
名称	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
信息披露负责人	姓名 魏丰 电话 021-61055090 021-61079900 电子邮箱 uxp@jhsd.com.cn dlw@ccbm@jhsd.com jhsd@china.com.cn
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000 010-62759966
官方网站	www.jhsd.com.cn www.ccb.com.cn
基金半年度报告备查地点	基金管理人办公场所

交银施罗德蓝筹股票证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

本等方进行了认真的复核,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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。
3.3 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
本托管人复核查看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:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金
报告截止日:2011年6月30日
单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
银行存款	6.4.7.1	1,594,685,144.45	718,681,006.22
结算备付金		6,425,173.10	39,788,191.74
存出保证金		8,468,290.84	6,972,252.77
交易性金融资产	6.4.7.2	8,127,276,356.77	10,076,324,749.52
其中:股票投资		7,928,273,325.50	9,479,471,207.53
债券投资		-	-
债券投资公允价值变动		-	-
资产支持证券		-	-
其中:资产支持证券	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,196,000,688.00	426,692,840.04
应收证券清算款		-	58,074,547.53
应收利息	6.4.7.5	2,057,878.97	8,533,433.27
应收申购款		419,286.40	-
递延所得税资产		66,122.45	387,682.71
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,936,299,620.98	11,335,454,703.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010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		1,023,702,822.44	-
应付赎回款		4,030,725.17	3,378,984.66
应付管理人报酬		11,861,992.03	14,744,019.27
应付托管费		1,976,989.69	2,457,336.54
应付交易费用	6.4.7.7	6,710,701.08	18,704,292.58
应付销售服务费		-	-
应付利息		-	-
应付股利		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,227,055.55	1,952,836.60
负债合计		1,050,510,297.96	41,237,489.85
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	12,793,143,283.32	13,499,297,957.36
未分配利润		-2,907,353,960.30	-2,205,080,734.42
所有者权益合计		9,885,789,323.02	11,294,217,213.94
负债和所有者权益总计		10,936,299,620.98	11,335,454,703.79

注:1.报告截止日2011年6月30日,基金份额净值0.7727元,基金份额净值12,793,143,283.32份。
2.本报告期内,资产负债表所有者权益附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解基础和附注的内容,应阅读披露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:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、收入		7,149,337,646.74	-7,149,337,646.74
1.利息收入		16,159,765.84	13,745,398.70
其中:存款利息收入	6.4.7.11	3,138,054.03	5,340,816.59
债券利息收入		8,306,484.74	6,973,675.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产利息收入		4,714,863.07	1,430,907.03
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)		-425,645,161.95	-56,797,734.29
其中:股权投资收益	6.4.7.12	-472,644,709.00	-97,779,520.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,152,679.03	-1,901,713.29
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	50,152,226.08	42,883,499.14
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-304,922,966.46	-2,900,217,574.19
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	50,713.83	221,780.67
减:费用		122,406,412.42	159,706,414.40
1.管理人报酬		77,514,134.17	94,134,134.17
2.托管费		12,919,022.42	15,851,773.07
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	31,711,260.52	48,483,523.24
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	261,995.31	260,479.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-836,764,059.16	-3,102,754,543.51
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-836,764,059.16	-3,102,754,543.51

注:1.本报告期利润总额和所得税费用附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解基础和附注的内容,应阅读披露于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.3 利润分配表
会计主体:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、期初未分配利润		12,793,143,283.32	13,499,297,957.36
二、本期利润分配		-2,907,353,960.30	-2,205,080,734.42
三、期末未分配利润		9,885,789,323.02	11,294,217,213.94
四、期末所有者权益合计		10,936,299,620.98	11,335,454,703.79

注:1.本报告期未分配利润和所有者权益附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解基础和附注的内容,应阅读披露于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.4 现金流量表
会计主体:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、经营活动产生的现金流量		13,499,297,957.36	-2,205,080,734.42
1.收到其他与经营活动有关的现金		-836,764,059.16	-836,764,059.16
二、投资活动产生的现金流量		-706,154,674.04	134,490,842.28
1.取得投资收益收到的现金		74,686,579.96	-158,408,872.15
2.处置金融资产收到的现金		-780,841,248.00	149,899,714.43
三、筹资活动产生的现金流量		-	-
四、期末所有者权益合计		12,793,143,283.32	-2,907,353,960.30
五、期末未分配利润		9,885,789,323.02	11,294,217,213.94

注:1.本报告期经营活动产生的现金流量净额、投资活动产生的现金流量净额、筹资活动产生的现金流量净额、期末未分配利润和所有者权益附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解基础和附注的内容,应阅读披露于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.5 所有者权益变动表
会计主体:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		13,499,297,957.36	13,499,297,957.36
二、本期利润分配		-2,907,353,960.30	-2,205,080,734.42
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(减少以“-”号填列)		-706,154,674.04	134,490,842.28
其中:1.基金申购款		74,686,579.96	59,277,701.51
2.基金赎回款		-780,841,248.00	149,899,714.43
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(减少以“-”号填列)		-	-
五、期末所有者权益(基金净值)		12,793,143,283.32	-2,907,353,960.30

注:1.本报告期所有者权益变动表附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解基础和附注的内容,应阅读披露于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.6 费用
会计主体:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、期间费用		122,406,412.42	159,706,414.40
1.销售费用		77,514,134.17	94,134,134.17
2.管理费用		12,919,022.42	15,851,773.07
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	31,711,260.52	48,483,523.24
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	261,995.31	260,479.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-836,764,059.16	-3,102,754,543.51
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-836,764,059.16	-3,102,754,543.51

注:1.本报告期期间费用附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解基础和附注的内容,应阅读披露于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.7 投资收益
会计主体:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、期间费用		122,406,412.42	159,706,414.40
1.销售费用		77,514,134.17	94,134,134.17
2.管理费用		12,919,022.42	15,851,773.07
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	31,711,260.52	48,483,523.24
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	261,995.31	260,479.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-836,764,059.16	-3,102,754,543.51
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-836,764,059.16	-3,102,754,543.51

注:1.本报告期期间费用附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解基础和附注的内容,应阅读披露于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.8 公允价值变动收益
会计主体:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、期间费用		122,406,412.42	159,706,414.40
1.销售费用		77,514,134.17	94,134,134.17
2.管理费用		12,919,022.42	15,851,773.07
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	31,711,260.52	48,483,523.24
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	261,995.31	260,479.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-836,764,059.16	-3,102,754,543.51
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-836,764,059.16	-3,102,754,543.51

注:1.本报告期期间费用附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解基础和附注的内容,应阅读披露于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.9 公允价值变动收益
会计主体:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、期间费用		122,406,412.42	159,706,414.40
1.销售费用		77,514,134.17	94,134,134.17
2.管理费用		12,919,022.42	15,851,773.07
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	31,711,260.52	48,483,523.24
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	261,995.31	260,479.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-836,764,059.16	-3,102,754,543.51
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-836,764,059.16	-3,102,754,543.51

注:1.本报告期期间费用附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解基础和附注的内容,应阅读披露于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.10 公允价值变动收益
会计主体:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、期间费用		122,406,412.42	159,706,414.40
1.销售费用		77,514,134.17	94,134,134.17
2.管理费用		12,919,022.42	15,851,773.07
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	31,711,260.52	48,483,523.24
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	261,995.31	260,479.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-836,764,059.16	-3,102,754,543.51
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-836,764,059.16	-3,102,754,543.51

注:1.本报告期期间费用附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解基础和附注的内容,应阅读披露于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.11 公允价值变动