



信息披露

2014年8月25日 星期一
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B141

交银施罗德蓝筹股票证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

本基金本报告期内未进行利润分配。

5.5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守诚信情况声明

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的行为,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 托管人对本报告期内本基金投资运作遵守法规、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,对本基金的资金资产净值进行复核,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。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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。

5.6 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:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
银行存款		417,859,177.63	613,382,135.58
结算备付金	6.4.7.1	13,155,233.10	4,631,777.04
存出保证金		2,184,613.00	1,692,022.79
交易性金融资产	6.4.7.2	5,113,094,312.28	5,099,328,841.84
其中:股票投资		4,864,690,713.32	5,730,027,619.66
基金投资		-	-
债券投资		248,403,598.96	209,301,222.18
资产支持证券投资		-	-
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	991,403,204.71	1,211,415,917.28
应收证券清算款		57,004,786.51	-
应收利息	6.4.7.5	6,484,744.58	5,907,544.90
应收股利		-	-
应收申购款		182,979.64	110,562.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	6,601,369,051.45	7,776,188,792.16
资产总计		6,601,369,051.45	7,776,188,792.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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		6,469,522.42	60,465,779.52
应付赎回款		8,059,779.01	9,764,417.74
应付管理人报酬		1,343,296.48	1,627,402.96
应付托管费		-	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,888,677.63	5,611,807.72
应付税费		-	-
应付利息		-	-
应付债券利息		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	224,178.57	451,219.59
负债合计		20,895,454.11	91,384,863.00
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	9,534,376,014.48	10,247,023,665.10
未分配利润	6.4.7.10	-2,951,992,417.14	-2,562,179,675.94
未分配利润		6,580,383,597.34	7,684,883,929.16
所有者权益合计		6,601,369,051.45	7,776,188,792.16

注:1、本报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.6902元,基金份额总额9,534,376,014.48份。

2、本报告中期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,应阅读载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 中期报告

会计主体:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	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		-510,445,534.92	78,964,914.37
1.利息收入		-22,286,635.82	13,688,959.14
其中:存款利息收入	6.4.7.11	6,031,897.76	3,939,034.36
债券利息收入		3,090,929.94	2,344,408.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,203,811.32	7,405,616.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“一”号填列)		27,156,076.98	222,768,718.37
其中:对联营企业和合营企业的投资收益	6.4.7.12	26,329,395.95	174,008,030.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,138,458.67	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具损益	6.4.7.15	-	-
公允价值变动收益(损失以“一”号填列)	6.4.7.16	25,752,288.36	48,738,687.59
3.公允价值变动收益(损失以“一”号填列)	6.4.7.17	-599,894,674.48	-157,499,078.21
4.汇兑收益(损失以“一”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“一”号填列)	6.4.7.18	6,426.76	28,315.07
减:二、费用		81,126,397.56	93,896,595.01
1.管理人报酬		52,463,562.27	62,178,196.56
2.托管费		8,743,927.01	10,363,032.72
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	19,632,014.86	21,091,624.50
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.20	289,892.42	283,741.23
三、净利润(亏损总额以“一”号填列)		-591,574,932.48	-14,999,680.64
减:所得税费用		-	-
净利润(亏损总额以“一”号填列)		-591,574,932.48	-14,999,680.64

6.3 所有者权益(基金净值)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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	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、期初所有者权益(基金净值)		10,247,023,665.10	7,684,883,929.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-2,562,179,675.94	-2,562,179,675.94
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期申购减少以“一”号填列)		-712,647,590.62	199,801,19.28
其中:1.基金申购款		17,324,175.73	-4,843,609.77
2.基金赎回款		-729,971,766.35	204,645,801.05
三、期末所有者权益(基金净值)		9,534,376,014.48	6,580,383,597.34
四、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-591,574,932.48	-14,999,680.64
五、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期申购减少以“一”号填列)		-654,825,286.63	173,887,646.19
其中:1.基金申购款		33,614,590.27	-9,117,844.70
2.基金赎回款		-688,439,876.90	183,005,490.89
六、期末所有者权益(基金净值)		11,110,276,768.50	7,876,311,142.12

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:许珊珊,会计机构负责人:李鸣

6.4 报告附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德蓝筹股票证券投资基金(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[2007]第265号《关于同意交银施罗德蓝筹股票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(以下简称“基金管理人”)和(交银施罗德基金管理有限公司)共同发起设立,基金合同于2007年8月8日生效。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募集额人民币1,741,756,475.13元,业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[2007]第105号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德蓝筹股票证券投资基金合同》于2007年8月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为11,743,885,724.35份基金份额,其中认购资金利息折合2,129,249.23份基金份额。本基金的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《交银施罗德蓝筹股票证券投资基金基金合同》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,包括国内依法发行上市的本基金、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年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:75%×中证100指数+25%×中信标普全债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部于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》、《证券投资基金信息披露业务指引》、《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》、《交银施罗德蓝筹股票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会计处理实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年上半年度财务报告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事项。

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

6.4.5 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

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

本基金在本报告期内无需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[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》及其他相关税收法规和实务操作,主要税项列示如下:

6	000703	三一重工	166,756,893.88	2.17
7	002008	大康农业	162,748,651.60	2.12
8	601299	中国北车	156,394,298.87	2.04
9	600389	特变电工	151,045,963.39	2.00
10	600276	恒瑞医药	146,195,588.48	1.90
11	600996	新安股份	135,337,982.46	1.76
12	000938	紫光股份	134,398,820.99	1.75
13	002455	深信服科技	130,320,419.90	1.70
14	600084	鹏博士	128,579,183.17	1.67
15	600900	青岛海尔	125,337,401.53	1.63
16	000538	云南白药	124,015,396.38	1.61
17	002341	威尔药业	121,634,041.66	1.58
18	000902	万科A	119,800,442.26	1.56
19	600741	华域汽车	119,699,284.19	1.56
20	000800	一汽轿车	108,381,753.68	1.41

注:“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票的成本(成交金额)	卖出股票的收入(成交金额)
6,248,636,366.13	6,552,960,326.42

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	210,152,000.00	3.19
其中:政策性金融债		210,152,000.00	3.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	38,251,596.96	0.58
8	其他	-	-
9	合计	248,403,598.96	3.77

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	130423	13国债03	500,000	50,055,000.00	0.76
2	110260	11国债06	500,000	49,855,000.00	0.76
3	140204	14国债04	400,000	40,180,000.00	0.61
4	130236	13国债36	400,000	40,008,000.00	0.61
5	130428	13国债28	300,000	30,054,000.00	0.46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年

内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,184,613.00
2	应收证券清算款	57,004,786.51
3	应收股利	-
4	应收利息	6,484,744.58
5	应收申购款	182,979.64
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	65,887,123.73

7.12.4 期末未持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	27,861,713.00	0.42
2	110023	民生转债	7,802,624.00	0.12
3	128002	东钢转债	2,487,261.96	0.04

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

份额单位:份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比例
618,057	15,426.37	91,714,032.79	0.96%	9,442,661,981.69	99.04%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末,本基金管理人的从业人员(包括本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究人员)均无持有本基金,本基金基金经理未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金开放式基金份额总量的情况

本报告期末,本基金管理人的从业人员(包括本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究人员)均无持有本基金,本基金基金经理未持有本基金。

8.4 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.5 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.6 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.7 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.8 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.9 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.10 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.11 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.12 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.13 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.14 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.15 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.16 期末基金持有人户数及持有本基金的情况

本报告期末,本基金持有人户数及持有本基金的情况如下:

8.17 期末基金