**交银施罗德环球精选价值证券投资基金**

**2016年半年度报告**

**2016年6月30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**

**报告送出日期：二〇一六年八月二十七日**

# **§1 重要提示及目录**

## 1.1 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根据本基金合同规定，于2016年8月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

**1.2 目录**

[**§1 重要提示及目录** 2](#_Toc459746787)

[1.1 重要提示 2](#_Toc459746788)

[**§2 基金简介** 5](#_Toc459746789)

[2.1基金基本情况 5](#_Toc459746790)

[2.2 基金产品说明 5](#_Toc459746791)

[2.3 基金管理人和基金托管人 5](#_Toc459746792)

[2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 6](#_Toc459746793)

[2.5 信息披露方式 6](#_Toc459746794)

[2.6 其他相关资料 6](#_Toc459746795)

[**§3 主要财务指标和基金净值表现** 7](#_Toc459746796)

[3.1 主要会计数据和财务指标 7](#_Toc459746797)

[3.2 基金净值表现 7](#_Toc459746798)

[**§4 管理人报告** 9](#_Toc459746799)

[4.1 基金管理人及基金经理情况 9](#_Toc459746800)

[4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 12](#_Toc459746801)

[4.3管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12](#_Toc459746802)

[4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12](#_Toc459746803)

[4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 13](#_Toc459746804)

[4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13](#_Toc459746805)

[4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14](#_Toc459746806)

[4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14](#_Toc459746807)

[4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14](#_Toc459746808)

[**§5 托管人报告** 14](#_Toc459746809)

[5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14](#_Toc459746810)

[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 14](#_Toc459746811)

[5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15](#_Toc459746812)

[**§6** **半年度财务会计报告（未经审计）** 15](#_Toc459746813)

[6.1 资产负债表 15](#_Toc459746814)

[6.2 利润表 16](#_Toc459746815)

[6.3 所有者权益（基金净值）变动表 18](#_Toc459746816)

[6.4 报表附注 19](#_Toc459746817)

[**§7投资组合报告** 35](#_Toc459746818)

[7.1期末基金资产组合情况 35](#_Toc459746819)

[7.2期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 36](#_Toc459746820)

[7.3期末按行业分类的权益投资组合 36](#_Toc459746821)

[7.4期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 37](#_Toc459746822)

[7.5报告期内权益投资组合的重大变动 47](#_Toc459746823)

[7.6期末按债券信用等级分类的债券投资组合 49](#_Toc459746824)

[7.7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 49](#_Toc459746825)

[7.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 49](#_Toc459746826)

[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金融衍生品投资明细 49](#_Toc459746827)

[7.10期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 49](#_Toc459746828)

[7.11投资组合报告附注 49](#_Toc459746829)

[**§8基金份额持有人信息** 50](#_Toc459746830)

[8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 50](#_Toc459746831)

[8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 50](#_Toc459746832)

[8.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 50](#_Toc459746833)

[**§9开放式基金份额变动** 51](#_Toc459746834)

[**§10重大事件揭示** 51](#_Toc459746835)

[10.1基金份额持有人大会决议 51](#_Toc459746836)

[10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 51](#_Toc459746837)

[10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 51](#_Toc459746838)

[10.4 基金投资策略的改变 51](#_Toc459746839)

[10.5报告期内改聘会计师事务所情况 51](#_Toc459746840)

[10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 52](#_Toc459746841)

[10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 52](#_Toc459746842)

[10.8其他重大事件 67](#_Toc459746843)

[**§11备查文件目录** 69](#_Toc459746844)

[11.1 备查文件目录 69](#_Toc459746845)

[11.2存放地点 69](#_Toc459746846)

[11.3查阅方式 69](#_Toc459746847)

# **§2 基金简介**

## 2.1基金基本情况

|  |  |
| --- | --- |
| 基金名称 | 交银施罗德环球精选价值证券投资基金 |
| 基金简称 | 交银环球精选混合(QDII) |
| 基金主代码 | 519696 |
| 交易代码 | 519696 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年8月22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 | 59,511,542.61份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

## 2.2 基金产品说明

|  |  |
| --- | --- |
| 投资目标 | 通过全球资产配置和灵活分散投资，在有效分散和控制风险的前提下，实现长期资本增值。 |
| 投资策略 | 自上而下配置资产，通过对全球宏观经济和各经济体的基本面分析，在不同区域间进行有效资产配置，自下而上精选证券，挖掘定价合理、具备持续竞争优势的上市公司股票进行投资，并有效控制下行风险。 |
| 业绩比较基准 | 70%×标准普尔全球大中盘指数(S&P Global LargeMidCap Index)+30%×恒生指数 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金，其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。此外，本基金在全球范围内进行投资，除了需要承担国际市场的市场波动风险之外，还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。 |

## 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 | 姓名 | 孙艳 | 田青 |
| 联系电话 | （021）61055050 | 010-67595096 |
| 电子邮箱 | xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-5000，021-61055000 | 010-67595096 |
| 传真 | | （021）61055054 | 010-66275853 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层（裙） | 北京市西城区金融大街25号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | | 于亚利 | 王洪章 |

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 项目 | | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
| 名称 | 英文 | Schroder Investment Management Limited | JPMorgan Chase Bank，National Association |
| 中文 | 施罗德投资管理有限公司 | 摩根大通银行 |
| 注册地址 | | 英国伦敦 | 1111 Polaris Parkway, Columbus, OH43240, U.S.A. |
| 办公地址 | | 31 Gresham Street London | 270 Park Avenue, New York, New York 10017 |
| 邮政编码 | | EC2V 7QA | 10017 |

## 2.5 信息披露方式

|  |  |
| --- | --- |
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fund001.com，www.bocomschroder.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

## 2.6 其他相关资料

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 名称 | 办公地址 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街17号 |

# **§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（2016年1月1日至2016年6月30日）** |
| 本期已实现收益 | -3,589,115.13 |
| 本期利润 | -2,215,534.08 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0374 |
| 本期加权平均净值利润率 | -2.58% |
| 本期基金份额净值增长率 | -2.38% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | **报告期末(2016年6月30日)** |
| 期末可供分配利润 | 29,600,130.47 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.497 |
| 期末基金资产净值 | 89,111,673.08 |
| 期末基金份额净值 | 1.497 |
| **3.1.3 累计期末指标** | **报告期末(2016年6月30日)** |
| 基金份额累计净值增长率 | 86.80% |

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，计入费用后的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③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
| 过去一个月 | -0.66% | 1.55% | -0.54% | 1.55% | -0.12% | 0.00% |
| 过去三个月 | 2.89% | 1.01% | 0.23% | 1.05% | 2.66% | -0.04% |
| 过去六个月 | -2.38% | 1.03% | -1.50% | 1.06% | -0.88% | -0.03% |
| 过去一年 | -9.98% | 1.23% | -10.27% | 1.08% | 0.29% | 0.15% |
| 过去三年 | 24.82% | 0.95% | 9.26% | 0.77% | 15.56% | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | 86.80% | 1.01% | 19.73% | 1.20% | 67.07% | -0.19% |

注：本基金的业绩比较基准为70%×标准普尔全球大中盘指数(S&P Global LargeMidCap Index)+30%×恒生指数，每日进行再平衡过程。

**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**

交银施罗德环球精选价值证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2008年8月22日至2016年6月30日）



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

# **§4 管理人报告**

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

**4.1.1基金管理人及其管理基金的经验**

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于2005年8月4日，注册地在中国上海，注册资本金为2亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有65%的股份，施罗德投资管理有限公司持有30%的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的54只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII等不同类型基金。

**4.1.2基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理  （助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
| 任职日期 | 离任日期 |
| 蔡铮 | 交银环球精选混合(QDII)、交银上证180公司治理ETF及其联接、交银深证300价值ETF及其联接、交银全球资源混合(QDII)、交银国证新能源指数分级、交银中证海外中国互联网指数（QDII-LOF)、交银中证互联网金融指数分级、交银中证环境治理指数分级的基金经理，公司量化投资部助理总经理 | 2015-04-22 | - | 7年 | 蔡铮先生，中国国籍，复旦大学电子工程硕士。历任瑞士银行香港分行分析员。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任投资研究部数量分析师、基金经理助理。2012年12月27日至2015年6月30日担任交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金经理。 |
| 陈俊华 | 交银环球精选混合(QDII)、交银全球资源混合(QDII)的基金经理 | 2015-11-21 | - | 11年 | 陈俊华女士，中国国籍，上海交通大学金融学硕士。历任国泰君安证券研究部研究员、中国国际金融有限公司研究部公用事业组负责人。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。 |
| 周中 | 交银环球精选混合(QDII)、交银全球资源混合(QDII)的基金经理 | 2015-12-12 | - | 7年 | 周中先生，中国国籍，复旦大学金融学硕士。历任野村证券亚太区股票研究部研究助理，中银国际证券研究部研究员、高级经理，瑞银证券研究部行业分析师、董事。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。 |

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告(如适用)之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

## 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 姓名 | 在境外投资顾问所任职务 | 证券从业年限 | 说明 |
| Simon Webber | 施罗德集团多区域（全球及国际）股票投资主管、全球和国际股票基金经理、全球气候变化股票基金经理 | 17年 | Simon Webber先生，英国曼彻斯特大学物理学学士，CFA。1999年加入施罗德投资管理有限公司，历任全球技术团队分析员。 |

## 4.3管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

**4.4.1公平交易制度的执行情况**

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

**4.4.2异常交易行为的专项说明**

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况有1次，是投资组合在合规范围内因被动超标调整需要而发生同日反向交易，未发现不公平交易和利益输送的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未发现异常。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

**4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析**

回顾上半年，震荡成为全球的主题，投资者的避险情绪在不断积聚。资产价格已经体现了投资者的态度：美元、日元和黄金走强，其余货币和金属走弱。仅美国股指在上半年取得微小正收益，其余主要股市全部下跌。我们认为，出现这一结果的内在原因，是全球经济复苏低于预期，全球再平衡的过程比我们预期的要波折和复杂。汇率为国家间再平衡的代表性指标，未来仍存不确定性，这也意味着大宏观背景下的波动仍在，下半年，我们仍需关注宏观经济不确定对投资的影响，继续贯彻优选龙头的思路，严控基本面风险。

组合操作方面，上半年，我们坚守龙头，注重锁定收益，规避重度投资相关行业。在整体避险情绪为主的大环境下，我们坚守龙头策略，专注主业稳健的龙头企业，对转型的企业保持谨慎。此外，我们注重锁定既有收益，操作更为灵活。在板块偏好方面，我们偏好与日常消费相关的行业（家电、汽车、软件等），规避与重度投资相关的行业。有个例外是国内的轨交产业链，我们认为这一领域还将有望长期获得正增长。经过我们的调整，二季度我们取得了正收益，将一季度全球暴跌带来的回撤基本修复，组合结构更趋稳健，仓位保持在一个均衡水平。

**4.5.2报告期内基金的业绩表现**

截至2016年6月30日，本基金份额净值为1.497元，本报告期份额净值增长率为-2.38%，同期业绩比较基准增长率为-1.50%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们对国内谨慎乐观，更加关注来自美国市场的不确定性影响。1）各类资产价格走势已经表明：投资者普遍处在一个预期非常谨慎的阶段，风险得到一定释放；2）海外方面，短期我们更加关注美国，顾虑美国上市公司在中报后是否会下调盈利而引发市场向下。毕竟，美国市场持续处于高位，没有发生大级别的调整，而月度经济数据并不支持企业盈利增速仍处高位的判断。对于英国而言，退欧的具体条款或将在两年内逐步明朗，其影响也必将是个长期和逐步的过程；3）选股方面，我们谨慎乐观，认为局部机会仍在。我们注意到，经历上半年的震荡，许多板块估值已处底部，而基本面方面，TMT、医疗、新能源汽车等领域，研发推广、步入商业化的进程仍有惊喜。具有高度进入壁垒的一些龙头公司，其分红收益率也达到了6%以上。中长期来看，这些都将有望为投资者带来不错的回报。我们必将更加勤勉积极，努力为投资者获取更优异的投资回报。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

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贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对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适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，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。基金经理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。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，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金本报告期内对上一年度应分配的可分配利润进行了收益分配，具体情况参见6.4.11利润分配情况。

本基金未对本报告期内利润进行分配。

## 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

# **§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 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，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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额：3,448,881.18元。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **资产** | **附注号** | **本期末**  **2016年6月30日** | **上年度末**  **2015年12月31日** |
| **资产：** |  |  |  |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 4,750,020.38 | 5,202,004.01 |
| 结算备付金 |  | - | - |
| 存出保证金 |  | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 84,781,967.11 | 87,160,169.42 |
| 其中：股票投资 |  | 84,781,967.11 | 87,160,169.42 |
| 基金投资 |  | - | - |
| 债券投资 |  | - | - |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 |  | - | 672,420.39 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 300.71 | 153.61 |
| 应收股利 |  | 425,916.45 | 58,880.05 |
| 应收申购款 |  | 288,062.17 | 10,795.49 |
| 递延所得税资产 |  | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | 1,011,779.49 |
| **资产总计** |  | 90,246,266.82 | 94,116,202.46 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末**  **2016年6月30日** | **上年度末**  **2015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 |  | 581,447.41 | 512,228.40 |
| 应付赎回款 |  | 287,518.60 | 95,995.74 |
| 应付管理人报酬 |  | 129,945.72 | 140,089.97 |
| 应付托管费 |  | 25,267.23 | 27,239.71 |
| 应付销售服务费 |  | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应交税费 |  | - | - |
| 应付利息 |  | - | - |
| 应付利润 |  | - | - |
| 递延所得税负债 |  | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 110,414.78 | 1,109,523.11 |
| **负债合计** |  | **1,134,593.74** | **1,885,076.93** |
| **所有者权益：** |  |  |  |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 59,511,542.61 | 57,715,799.32 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 29,600,130.47 | 34,515,326.21 |
| **所有者权益合计** |  | **89,111,673.08** | **92,231,125.53** |
| **负债和所有者权益总计** |  | **90,246,266.82** | **94,116,202.46** |

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.497元，基金份额总额59,511,542.61份。

## 6.2 利润表

会计主体：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **项目** | **附注号** | **本期**  **2016年1月1日至2016年6月30日** | **上年度可比期间**  **2015年1月1日至2015年6月30日** |
| **一、收入** |  | **-1,078,444.21** | **11,467,328.35** |
| 1.利息收入 |  | 4,282.54 | 18,642.89 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 4,282.54 | 18,642.89 |
| 债券利息收入 |  | - | - |
| 资产支持证券利息收入 |  | - | - |
| 买入返售金融资产收入 |  | - | - |
| 其他利息收入 |  | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |  | -2,550,465.20 | 7,467,766.74 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -3,613,505.52 | 6,368,814.15 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 贵金属投资收益 |  | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.16 | 15,417.31 | 26,746.42 |
| 股利收益 | 6.4.7.17 | 1,047,623.01 | 1,072,206.17 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 1,373,581.05 | 3,704,313.06 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） |  | 91,833.97 | 251,071.32 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 | 2,323.43 | 25,534.34 |
| **减：二、费用** |  | **1,137,089.87** | **1,712,545.58** |
| 1．管理人报酬 |  | 766,877.50 | 1,122,280.56 |
| 2．托管费 |  | 149,115.10 | 218,221.24 |
| 3．销售服务费 |  | - | - |
| 4．交易费用 | 6.4.7.20 | 110,115.85 | 325,246.05 |
| 5．利息支出 |  | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |  | - | - |
| 6．其他费用 | 6.4.7.21 | 110,981.42 | 46,797.73 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** |  | **-2,215,534.08** | **9,754,782.77** |
| 减：所得税费用 |  | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** |  | **-2,215,534.08** | **9,754,782.77** |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **项目** | **本期**  **2016年1月1日至2016年6月30日** | | |
| **实收基金** | **未分配利润** | **所有者权益合计** |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 57,715,799.32 | 34,515,326.21 | 92,231,125.53 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -2,215,534.08 | -2,215,534.08 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 1,795,743.29 | 749,219.52 | 2,544,962.81 |
| 其中：1.基金申购款 | 4,775,667.18 | 2,132,998.45 | 6,908,665.63 |
| 2.基金赎回款 | -2,979,923.89 | -1,383,778.93 | -4,363,702.82 |
| 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） | - | -3,448,881.18 | -3,448,881.18 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 59,511,542.61 | 29,600,130.47 | 89,111,673.08 |
| **项目** | **上年度可比期间**  **2015年1月1日至2015年6月30日** | | |
| **实收基金** | **未分配利润** | **所有者权益合计** |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 77,178,116.21 | 51,091,684.10 | 128,269,800.31 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 9,754,782.77 | 9,754,782.77 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -10,570,245.28 | -7,001,551.46 | -17,571,796.74 |
| 其中：1.基金申购款 | 20,697,502.12 | 16,136,452.56 | 36,833,954.68 |
| 2.基金赎回款 | -31,267,747.40 | -23,138,004.02 | -54,405,751.42 |
| 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） | - | -5,012,791.66 | -5,012,791.66 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 66,607,870.93 | 48,832,123.75 | 115,439,994.68 |

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：阮红，主管会计工作负责人：夏华龙，会计机构负责人：朱鸣

## 6.4 报表附注

**6.4.1基金基本情况**

交银施罗德环球精选价值证券投资基金 (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”)证监许可[2008]第635号《关于核准交银施罗德环球精选价值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依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德环球精选价值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508,068,907.66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(2008)第130号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》于2008年8月22日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为508,425,627.85份基金份额，其中认购资金利息折合356,720.19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，境外资产托管人为摩根大通银行 (JPMorgan &Chase Bank, N.A.)，境外投资顾问为施罗德投资管理有限公司 (Schroder Investment Management Limited)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票 (包括股票存托凭证)，在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为：股票资产占基金资产的60%-100%，债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具占基金资产的0%-40%。本基金的业绩比较基准为：70%×标准普尔全球大中盘指数 (S&P Global LargeMidCap Index)+30%×恒生指数。

**6.4.2会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协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声明**

本基金2016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2016年6月30日的财务状况以及2016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相一致的说明**

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相一致。

**6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

**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**

本基金在本报告期间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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

**6.4.7重要财务报表项目的说明**

**6.4.7.1银行存款**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期末  2016年6月30日 |
| 活期存款 | 4,750,020.38 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 4,750,020.38 |

注：于2016年6月30日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款46,347.40 (折合人民币307,338.88元)和港币活期存款3,321,127.59 (折合人民币2,838,552.37元)。

**6.4.7.2交易性金融资产**

单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 项目 | | 本期末  2016年6月30日 | | |
| 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 75,920,627.44 | 84,781,967.11 | 8,861,339.67 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | |  |  |  |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| 银行间市场 | - | - | - |
| 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 75,920,627.44 | 84,781,967.11 | 8,861,339.67 |

**6.4.7.3衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

**6.4.7.4买入返售金融资产**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.5应收利息**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期末  2016年6月30日 |
| 应收活期存款利息 | 300.65 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | - |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 0.06 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 300.71 |

**6.4.7.6其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7应付交易费用**

本基金本报告期末无应付交易费用。

**6.4.7.8其他负债**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期末  2016年6月30日 |
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 1,018.22 |
| 预提审计费 | 19,890.78 |
| 预提信息披露费 | 89,505.78 |
| 合计 | 110,414.78 |

**6.4.7.9实收基金**

金额单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 | |
| 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 57,715,799.32 | 57,715,799.32 |
| 本期申购 | 4,775,667.18 | 4,775,667.18 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,979,923.89 | -2,979,923.89 |
| 本期末 | 59,511,542.61 | 59,511,542.61 |

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

**6.4.7.10未分配利润**

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 37,025,613.04 | -2,510,286.83 | 34,515,326.21 |
| 本期利润 | -3,589,115.13 | 1,373,581.05 | -2,215,534.08 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,026,039.47 | -276,819.95 | 749,219.52 |
| 其中：基金申购款 | 2,632,928.10 | -499,929.65 | 2,132,998.45 |
| 基金赎回款 | -1,606,888.63 | 223,109.70 | -1,383,778.93 |
| 本期已分配利润 | -3,448,881.18 | - | -3,448,881.18 |
| 本期末 | 31,013,656.20 | -1,413,525.73 | 29,600,130.47 |

**6.4.7.11存款利息收入**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 4,279.28 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | 3.26 |
| 合计 | 4,282.54 |

**6.4.7.12股票投资收益**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 33,077,552.83 |
| 减：卖出股票成本总额 | 36,691,058.35 |
| 买卖股票差价收入 | -3,613,505.52 |

**6.4.7.13基金投资收益**

本基金本报告期内无基金投资收益。

**6.4.7.14债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.15 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16衍生工具收益**

**6.4.7.16.1衍生工具收益——买卖权证差价收入**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 卖出权证成交总额 | 15,417.31 |
| 减：卖出权证成本总额 | - |
| 买卖权证差价收入 | 15,417.31 |

**6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

**6.4.7.17股利收益**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 1,047,623.01 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,047,623.01 |

**6.4.7.18公允价值变动收益**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目名称 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 1.交易性金融资产 | 1,373,581.05 |
| ——股票投资 | 1,373,581.05 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 合计 | 1,373,581.05 |

**6.4.7.19其他收入**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 2,323.43 |
| 合计 | 2,323.43 |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

**6.4.7.20交易费用**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 110,115.85 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 110,115.85 |

**6.4.7.21其他费用**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 审计费用 | 19,890.78 |
| 信息披露费 | 89,505.78 |
| 银行汇划费用 | 420.00 |
| 其他 | 1,164.86 |
| 合计 | 110,981.42 |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**6.4.8.1或有事项**

无。

**6.4.8.2资产负债表日后事项**

无。

**6.4.9关联方关系**

**6.4.9.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

|  |  |
| --- | --- |
| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
| 交银施罗德基金管理有限公司(“交银施罗德基金公司”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 摩根大通银行(JPMorgan &Chase Bank, N.A.) | 境外资产托管人 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

**6.4.10.2关联方报酬**

**6.4.10.2.1基金管理费**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 | 上年度可比期间  2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 766,877.50 | 1,122,280.56 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 93,125.55 | 136,013.24 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.8%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.8%÷当年天数。

**6.4.10.2.2基金托管费**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 | 上年度可比期间  2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 149,115.10 | 218,221.24 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.35%÷当年天数。

**6.4.10.2.3销售服务费**

无。

**6.4.10.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 | 上年度可比期间  2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 报告期初持有的基金份额 | 23,951,843.25 | 22,986,750.67 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 1,007,791.44 | 965,092.58 |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 24,959,634.69 | 23,951,843.25 |
| 报告期末持有的基金份额  占基金总份额比例 | 41.94% | 35.96% |

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

**6.4.10.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

**6.4.10.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 关联方名称 | 本期  2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间  2015年1月1日至2015年6月30日 | |
| 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 1,604,161.15 | 4,281.39 | 2,877,875.90 | 18,555.00 |
| 摩根大通银行 | 3,145,859.23 | -2.11 | 5,145,078.67 | 37.89 |

注：本基金的银行存款分别由基金托管人和境外资产托管人保管，按适用利率或约定利率计息。

**6.4.10.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.7其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**6.4.11利润分配情况**

单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 利润分配合计 | 备注 |
| 1 | 2016-01-13 | 2016-01-12 | 0.600 | 1,060,257.52 | 2,388,623.66 | 3,448,881.18 | - |
| 合计 |  |  | 0.600 | 1,060,257.52 | 2,388,623.66 | 3,448,881.18 | - |

**6.4.12期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**6.4.13金融工具风险及管理**

**6.4.13.1风险管理政策和组织架构**

本基金是一只混合型基金，其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。此外，本基金在全球范围内进行投资，除了需要承担国际市场的市场波动风险之外，还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

**6.4.13.2信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

为了规避信用风险，本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行以及境外次托管行摩根大通银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在在境内交易所进行的债券交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于2016年6月30日，本基金未持有信用类债券(2015年12月31日：无)。

**6.4.13.3流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的10%，持有货币市场基金可以不受上述限制，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的20%。本基金所持所有证券均在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

于2016年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值 (所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

**6.4.13.4市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

**6.4.13.4.1利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除银行存款外大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

**6.4.13.4.1.1利率风险敞口**

单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **本期末**  **2016年6月30日** | **1年以内** | **1-5年** | | **5年以上** | **不计息** | | | **合计** |
| **资产** |  |  | |  |  | | |  |
| 银行存款 | 4,750,020.38 | - | | - | - | | | 4,750,020.38 |
| 交易性金融资产 | - | - | | - | 84,781,967.11 | | | 84,781,967.11 |
| 应收利息 | - | - | | - | 300.71 | | | 300.71 |
| 应收股利 | - | - | | - | 425,916.45 | | | 425,916.45 |
| 应收申购款 | 795.23 | - | | - | 287,266.94 | | | 288,062.17 |
| **资产总计** | 4,750,815.61 | - | | - | 85,495,451.21 | | | 90,246,266.82 |
| 负债 |  |  | |  | |  | |  |
| 应付证券清算款 | - | - | | - | | 581,447.41 | | 581,447.41 |
| 应付赎回款 | - | - | | - | | 287,518.60 | | 287,518.60 |
| 应付管理人报酬 | - | - | | - | | 129,945.72 | | 129,945.72 |
| 应付托管费 | - | - | | - | | 25,267.23 | | 25,267.23 |
| 其他负债 | - | - | | - | | 110,414.78 | | 110,414.78 |
| 负债总计 | - | - | | - | | 1,134,593.74 | | 1,134,593.74 |
| 利率敏感度缺口 | 4,750,815.61 | - | | - | | 84,360,857.47 | | 89,111,673.08 |
| **上年度末**  **2015年12月31日** | **1年以内** | | **1-5年** | **5年以上** | | | **不计息** | **合计** |
| **资产** |  | |  |  | | |  |  |
| 银行存款 | 5,202,004.01 | | - | - | | | - | 5,202,004.01 |
| 交易性金融资产 | - | | - | - | | | 87,160,169.42 | 87,160,169.42 |
| 应收证券清算款 | - | | - | - | | | 672,420.39 | 672,420.39 |
| 应收利息 | - | | - | - | | | 153.61 | 153.61 |
| 应收股利 | - | | - | - | | | 58,880.05 | 58,880.05 |
| 应收申购款 | - | | - | - | | | 10,795.49 | 10,795.49 |
| 其他资产 | - | | - | - | | | 1,011,779.49 | 1,011,779.49 |
| **资产总计** | 5,202,004.01 | | - | - | | | 88,914,198.45 | 94,116,202.46 |
| 负债 |  | |  |  | | |  |  |
| 应付证券清算款 | - | | - | - | | | 512,228.40 | 512,228.40 |
| 应付赎回款 | - | | - | - | | | 95,995.74 | 95,995.74 |
| 应付管理人报酬 | - | | - | - | | | 140,089.97 | 140,089.97 |
| 应付托管费 | - | | - | - | | | 27,239.71 | 27,239.71 |
| 其他负债 | - | | - | - | | | 1,109,523.11 | 1,109,523.11 |
| 负债总计 | - | | - | - | | | 1,885,076.93 | 1,885,076.93 |
| 利率敏感度缺口 | 5,202,004.01 | | - | - | | | 87,029,121.52 | 92,231,125.53 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

**6.4.13.4.1.2利率风险的敏感性分析**

于2016年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2015年12月31日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015年12月31日：同)。

**6.4.13.4.2外汇风险**

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

**6.4.13.4.2.1外汇风险敞口**

单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **项目** | **本期末**  **2016年6月30日** | | | |
| **美元**  **折合人民币** | **港币**  **折合人民币** | **其他币种**  **折合人民币** | **合计** |
| **以外币计价的资产** |  |  |  |  |
| 银行存款 | 307,338.88 | 2,838,552.37 | - | 3,145,891.25 |
| 交易性金融资产 | 40,888,688.12 | 22,000,727.58 | 21,892,551.41 | 84,781,967.11 |
| 应收股利 | 53,069.43 | 139,539.10 | 39,732.32 | 232,340.85 |
| **资产合计** | **41,249,096.43** | **24,978,819.05** | **21,932,283.73** | **88,160,199.21** |
| **以外币计价的负债** |  |  |  |  |
| 应付证券清算款 | - | 581,447.41 | - | 581,447.41 |
| **负债合计** | **-** | **581,447.41** | **-** | **581,447.41** |
| **资产负债表外汇风险敞口净额** | **41,249,096.43** | **24,397,371.64** | **21,932,283.73** | **87,578,751.80** |
| **项目** | **上年度末**  **2015年12月31日** | | | |
| 美元  **折合人民币** | 港币  **折合人民币** | 其他币种  **折合人民币** | **合计** |
| **以外币计价的资产** |  |  |  |  |
| 银行存款 | 1,424,683.69 | 3,095,068.64 | - | 4,519,752.33 |
| 交易性金融资产 | 33,754,914.12 | 26,027,469.61 | 27,377,785.69 | 87,160,169.42 |
| 应收证券清算款 | 185,008.44 | - | 487,411.95 | 672,420.39 |
| 应收股利 | 24,428.27 | - | 34,451.78 | 58,880.05 |
| 其他资产 | 499,551.09 | - | 512,228.40 | 1,011,779.49 |
| **资产合计** | **35,888,585.61** | **29,122,538.25** | **28,411,877.82** | **93,423,001.68** |
| **以外币计价的负债** |  |  |  |  |
| 应付证券清算款 | - | - | 512,228.40 | 512,228.40 |
| 其他负债 | 512,101.27 | - | 487,411.95 | 999,513.22 |
| **负债合计** | **512,101.27** | **-** | **999,640.35** | **1,511,741.62** |
| **资产负债表外汇风险敞口净额** | **35,376,484.34** | **29,122,538.25** | **27,412,237.47** | **91,911,260.06** |

**6.4.13.4.2.2外汇风险的敏感性分析**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的  影响金额（单位：人民币万元） | |
| 本期末  2016年6月30日 | 上年度末  2015年12月31日 |
| 1.所有外币相对人民币升值5% | 增加约438 | 增加约460 |
| 2.所有外币相对人民币贬值5% | 减少约438 | 减少约460 |

**6.4.13.4.3其他价格风险**

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。股票资产占基金资产的60%-100%，债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具占基金资产的0%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

**6.4.13.4.3.1其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 项目 | 本期末  2016年6月30日 | | 上年度末  2015年12月31日 | |
| 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产－股票投资 | 84,781,967.11 | 95.14 | 87,160,169.42 | 94.50 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 84,781,967.11 | 95.14 | 87,160,169.42 | 94.50 |

**6.4.13.4.3.2其他价格风险的敏感性分析**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 假设 | 除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变 | | | |
| 分析 | | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的  影响金额（单位：人民币万元） | |
| 本期末  2016年6月30日 | 上年度末  2015年12月31日 |
| 1.业绩比较基准(附注6.4.1)上升5% | 增加约466 | 增加约556 |
| 2.业绩比较基准(附注6.4.1)下降5% | 减少约466 | 减少约556 |

# **§7投资组合报告**

## 7.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（％） |
| 1 | 权益投资 | 84,781,967.11 | 93.95 |
|  | 其中：普通股 | 84,008,482.06 | 93.09 |
|  | 存托凭证 | 773,485.05 | 0.86 |
|  | 优先股 | - | - |
|  | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
|  | 其中：债券 | - | - |
|  | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
|  | 其中：远期 | - | - |
|  | 期货 | - | - |
|  | 期权 | - | - |
|  | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,750,020.38 | 5.26 |
| 8 | 其他各项资产 | 714,279.33 | 0.79 |
| 9 | 合计 | 90,246,266.82 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

## 7.2期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 国家（地区） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（％） |
| 美国 | 40,161,617.23 | 45.07 |
| 香港 | 22,000,727.58 | 24.69 |
| 英国 | 8,232,953.30 | 9.24 |
| 日本 | 4,701,731.15 | 5.28 |
| 德国 | 3,054,364.31 | 3.43 |
| 瑞士 | 1,348,303.28 | 1.51 |
| 挪威 | 1,342,385.60 | 1.51 |
| 西班牙 | 897,731.56 | 1.01 |
| 瑞典 | 791,970.56 | 0.89 |
| 巴西 | 765,658.51 | 0.86 |
| 泰国 | 757,453.14 | 0.85 |
| 新加坡 | 727,070.89 | 0.82 |
| 合计 | 84,781,967.11 | 95.14 |

注：1、国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；

2、ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 7.3期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（％） |
| 金融 | 15,303,872.15 | 17.17 |
| 保健 | 12,685,373.86 | 14.24 |
| 信息技术 | 12,479,553.73 | 14.00 |
| 非必需消费品 | 12,181,660.47 | 13.67 |
| 工业 | 10,400,098.09 | 11.67 |
| 必需消费品 | 8,367,071.10 | 9.39 |
| 能源 | 5,189,193.50 | 5.82 |
| 材料 | 4,115,731.13 | 4.62 |
| 电信服务 | 3,137,966.00 | 3.52 |
| 公共事业 | 921,447.08 | 1.03 |
| 合计 | 84,781,967.11 | 95.14 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.4期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 公司名称 (英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（％） |
| 1 | Alphabet Inc | Alphabet公司 | GOOGL US | 美国证券交易所 | 美国 | 396 | 1,847,438.26 | 2.07 |
| 2 | Comcast Corporation | 康卡斯特公司 | CMCSA US | 美国证券交易所 | 美国 | 4,144 | 1,791,401.17 | 2.01 |
| 3 | Unitedhealth Group Inc | 美国联合健康集团 | UNH US | 美国证券交易所 | 美国 | 1,861 | 1,742,501.64 | 1.96 |
| 4 | Reckitt Benckiser Group Plc | 利洁时集团 | RB/ LN | 伦敦证券交易所 | 英国 | 2,543 | 1,695,138.47 | 1.90 |
| 5 | Amazon.Com Inc | 亚马逊公司 | AMZN US | 美国证券交易所 | 美国 | 345 | 1,637,169.67 | 1.84 |
| 6 | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控股 | 700 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 10,000 | 1,505,118.54 | 1.69 |
| 7 | Citigroup Inc | 花旗集团 | C US | 美国证券交易所 | 美国 | 5,229 | 1,469,853.95 | 1.65 |
| 8 | Imperial Brands PLC | 帝国烟草公司 | IMB LN | 伦敦证券交易所 | 英国 | 4,020 | 1,450,217.81 | 1.63 |
| 9 | Pfizer Inc | 辉瑞制药公司 | PFE US | 美国证券交易所 | 美国 | 6,037 | 1,409,546.24 | 1.58 |
| 10 | Thermo Fisher Scientific Inc | 赛默飞世尔科技公司 | TMO US | 美国证券交易所 | 美国 | 1,411 | 1,382,534.64 | 1.55 |
| 11 | Danaher Corp | 美国丹纳公司 | DHR US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,063 | 1,381,696.73 | 1.55 |
| 12 | Visa Inc | 维萨公司 | V US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,799 | 1,376,649.26 | 1.54 |
| 13 | Walgreens Boots Alliance Inc | 沃尔格林博兹联合公司 | WBA US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,486 | 1,372,719.54 | 1.54 |
| 14 | Union Pacific Corp | 联合太平洋公司 | UNP US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,353 | 1,361,380.39 | 1.53 |
| 15 | Estee Lauder Cos Inc | 雅诗兰黛公司 | EL US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,234 | 1,348,379.45 | 1.51 |
| 16 | Nestle SA | 雀巢集团 | NESN VX | 瑞士证券交易所 | 瑞士 | 2,635 | 1,348,303.28 | 1.51 |
| 17 | US Bancorp | 美国合众银行 | USB US | 美国证券交易所 | 美国 | 5,020 | 1,342,530.21 | 1.51 |
| 18 | Statoil ASA | 挪威国家石油公司 | STL NO | 挪威证券交易所 | 挪威 | 11,746 | 1,342,385.60 | 1.51 |
| 19 | Occidental Petroleum Corp | 西方石油公司 | OXY US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,646 | 1,325,787.49 | 1.49 |
| 20 | Apple Inc | 苹果公司 | AAPL US | 美国证券交易所 | 美国 | 1,985 | 1,258,376.30 | 1.41 |
| 21 | Medtronic PLC | 美敦力公司 | MDT US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,162 | 1,243,991.50 | 1.40 |
| 22 | Fuyao Glass Industry Group Co., Ltd. | 福耀玻璃工业集团股份有限公司 | 3606 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 79,400 | 1,218,816.11 | 1.37 |
| 23 | Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA | 费森尤斯医疗服务股份两合公司 | FME GR | 德国证券交易所 | 德国 | 2,094 | 1,209,870.63 | 1.36 |
| 24 | Amgen Inc | 安进公司 | AMGN US | 美国证券交易所 | 美国 | 1,197 | 1,207,697.68 | 1.36 |
| 25 | Colour Life Services Group Co., Limited | 彩生活服务集团有限公司 | 1778 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 256,000 | 1,172,778.80 | 1.32 |
| 26 | Ping An Insurance (Group) Company Of China,Ltd. | 中国平安保险(集团)股份有限公司 | 2318 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 40,000 | 1,167,513.87 | 1.31 |
| 27 | Schlumberger Ltd | 斯伦贝谢公司 | SLB US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,196 | 1,151,572.07 | 1.29 |
| 28 | Hewlett Packard Enterprise | 惠普公司 | HPE US | 美国证券交易所 | 美国 | 9,401 | 1,138,950.18 | 1.28 |
| 29 | JPMorgan Chase & Co | 摩根大通集团 | JPM US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,744 | 1,130,700.24 | 1.27 |
| 30 | Check Point Software Technologies Ltd | Check Point软件技术有限公司 | CHKP US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,074 | 1,095,847.71 | 1.23 |
| 31 | Dow Chemical Company | 陶氏化学公司 | DOW US | 美国证券交易所 | 美国 | 3,312 | 1,091,757.59 | 1.23 |
| 32 | Shire PLC | Shire公司 | SHP LN | 伦敦证券交易所 | 英国 | 2,507 | 1,035,482.84 | 1.16 |
| 33 | Interpublic Group of Companies | Interpublic 集团 | IPG US | 美国证券交易所 | 美国 | 6,368 | 975,454.82 | 1.09 |
| 34 | Prudential PLC | 英国保诚集团 | PRU LN | 伦敦证券交易所 | 英国 | 8,704 | 973,713.44 | 1.09 |
| 35 | Cognizant Technology Solutions | 高知特科技公司 | CTSH US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,555 | 969,801.06 | 1.09 |
| 36 | Cogobuy Group | 科通芯城集团 | 400 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 90,000 | 955,378.48 | 1.07 |
| 37 | Ingersoll-Rand PLC | 英格索兰 | IR US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,208 | 932,382.79 | 1.05 |
| 38 | Eaton Corp PLC | 伊顿公司 | ETN US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,339 | 926,434.81 | 1.04 |
| 39 | KDDI Corp | KDDI 株式会社 | 9433 JP | 日本证券交易所 | 日本 | 4,600 | 925,170.51 | 1.04 |
| 40 | Vodafone Group PLC | 沃达丰公司 | VOD LN | 伦敦证券交易所 | 英国 | 45,249 | 916,755.77 | 1.03 |
| 41 | Lloyds Banking Group PLC | 劳埃德银行集团 | LLOY LN | 伦敦证券交易所 | 英国 | 186,599 | 897,764.36 | 1.01 |
| 42 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria | 西班牙对外银行 | BBVA SM | 西班牙证券交易所 | 西班牙 | 24,052 | 897,731.56 | 1.01 |
| 43 | Keyence Corp | 西日本商工株式会社 | 6861 JP | 日本证券交易所 | 日本 | 200 | 893,396.40 | 1.00 |
| 44 | China Hongqiao Group Ltd | 中国宏桥集团有限公司 | 1378 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 200,000 | 888,883.18 | 1.00 |
| 45 | China State Construction International Holdings Limited | 中国建筑国际集团有限公司 | 3311 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 100,000 | 873,498.67 | 0.98 |
| 46 | Owens Corning | 欧文斯科宁公司 | OC US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,445 | 835,308.39 | 0.94 |
| 47 | Capita PLC | Capita公司 | CPI LN | 伦敦证券交易所 | 英国 | 9,621 | 823,706.11 | 0.92 |
| 48 | Mondelez International Inc | Mondelez国际公司 | MDLZ US | 美国证券交易所 | 美国 | 2,673 | 806,673.74 | 0.91 |
| 49 | SMC Corporation | 日本SMC公司 | 6273 JP | 日本证券交易所 | 日本 | 500 | 804,528.40 | 0.90 |
| 50 | Assa Abloy AB | 亚萨合莱集团 | ASSAB SS | 瑞典证券交易所 | 瑞典 | 5,878 | 791,970.56 | 0.89 |
| 51 | Sumitomo Mitsui Financial Group | 三井住友金融集团 | 8316 JP | 日本证券交易所 | 日本 | 4,100 | 775,073.71 | 0.87 |
| 52 | China Resources Land Limited | 华润置地有限公司 | 1109 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 50,000 | 773,499.31 | 0.87 |
| 53 | HDFC Bank Ltd | HDFC银行有限公司 | HDB US | 美国证券交易所 | 美国 | 1,758 | 773,485.05 | 0.87 |
| 54 | Telefonica Brasil SA | 巴西电信公司 | VIVT4 BZ | 巴西证券交易所 | 巴西 | 8,400 | 765,658.51 | 0.86 |
| 55 | Kasikornbank PCL | 泰华农民银行(大众)有限公司 | KBANK-R TB | 泰国证券交易所 | 泰国 | 23,600 | 757,453.14 | 0.85 |
| 56 | Kubota Corp | 久保田公司 | 6326 JP | 日本证券交易所 | 日本 | 8,300 | 733,314.47 | 0.82 |
| 57 | Cimarex Energy Corp | Cimarex 能源公司 | XEC US | 美国证券交易所 | 美国 | 919 | 727,144.77 | 0.82 |
| 58 | Jardine Strategic Holdings Ltd | 怡和策略控股 | JS SP | 新加坡证券交易所 | 新加坡 | 3,633 | 727,070.89 | 0.82 |
| 59 | Agricultural Bank of China Ltd | 中国农业银行股份有限公司 | 1288 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 300,000 | 725,636.37 | 0.81 |
| 60 | CRCC High-Tech Equipment Corporation Limited | 中国铁建高新装备股份有限公司 | 1786 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 250,000 | 720,080.85 | 0.81 |
| 61 | SAP SE | SAP公司 | SAP GR | 德国证券交易所 | 德国 | 1,444 | 718,548.66 | 0.81 |
| 62 | Facebook Inc | Facebook公司 | FB US | 美国证券交易所 | 美国 | 909 | 688,852.50 | 0.77 |
| 63 | Ball Corp | 波尔公司 | BLL US | 美国证券交易所 | 美国 | 1,411 | 676,390.29 | 0.76 |
| 64 | The TJX Companies, Inc. | TJX公司 | TJX US | 美国证券交易所 | 美国 | 1,302 | 666,790.10 | 0.75 |
| 65 | Skyworth Digital Holdings Limited | 创维数码控股有限公司 | 751 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 120,000 | 650,252.24 | 0.73 |
| 66 | Shanghai Jin Jiang International Hotels (Group) Company | 上海锦江国际酒店(集团)股份有限公司 | 2006 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 300,000 | 648,713.78 | 0.73 |
| 67 | Yanzhou Coal Mining Company Limited | 兖州煤业股份有限公司 | 1171 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 150,000 | 642,303.57 | 0.72 |
| 68 | Sunac China Holdings Limited | 融创中国控股有限公司 | 1918 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 150,000 | 615,380.66 | 0.69 |
| 69 | HeidelbergCement AG | 海德堡水泥股份有限公司 | HEI GR | 德国证券交易所 | 德国 | 1,149 | 575,793.37 | 0.65 |
| 70 | Bridgestone Corp | 普利司通株式会社 | 5108 JP | 日本证券交易所 | 日本 | 2,700 | 570,247.66 | 0.64 |
| 71 | Bayerische Motoren Werke AG | 宝马汽车股份有限公司 | BMW GR | 德国证券交易所 | 德国 | 1,129 | 550,151.65 | 0.62 |
| 72 | Celgene Corp | 新基医药 | CELG US | 美国证券交易所 | 美国 | 824 | 538,925.05 | 0.60 |
| 73 | Geely Automobile Holdings Limited | 吉利汽车控股有限公司 | 175 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 150,000 | 537,176.04 | 0.60 |
| 74 | Carnival Corp | 嘉年华公司 | CCL US | 美国证券交易所 | 美国 | 1,827 | 535,491.95 | 0.60 |
| 75 | China Mobile Limited | 中国移动有限公司 | 941 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 7,000 | 530,381.21 | 0.60 |
| 76 | China Huarong Asset Management Co., Ltd. | 中国华融资产管理股份有限公司 | 2799 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 200,000 | 523,073.57 | 0.59 |
| 77 | Chinasoft International Ltd. | 中软国际有限公司 | 354 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 200,000 | 516,236.00 | 0.58 |
| 78 | China Medical System Holdings Limited | 康哲药业控股有限公司 | 867 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 50,000 | 504,270.27 | 0.57 |
| 79 | Guangshen Railway Company Limited | 广深铁路股份有限公司 | 525 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 160,000 | 503,244.63 | 0.56 |
| 80 | Xinyi Glass Holdings Ltd | 信义玻璃控股有限公司 | 868 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 100,000 | 487,176.36 | 0.55 |
| 81 | Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd | 香港交易所 | 388 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 3,000 | 481,022.55 | 0.54 |
| 82 | BYD Company Limited | 比亚迪股份有限公司 | 1211 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 12,000 | 476,407.20 | 0.53 |
| 83 | Guangzhou Automobile Group Co.,Ltd. | 广州汽车集团股份有限公司 | 2238 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 60,000 | 474,355.93 | 0.53 |
| 84 | Huadian Power International Corporation Limited | 华电国际电力股份有限公司 | 1071 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 150,000 | 473,073.89 | 0.53 |
| 85 | CSPC Pharmaceutical Group Limited | 石药集团有限公司 | 1093 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 80,000 | 471,791.84 | 0.53 |
| 86 | China Merchants Bank Co Ltd | 招商银行 | 3968 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 30,000 | 444,612.53 | 0.50 |
| 87 | Zijin Mining Group Co.,Ltd. | 紫金矿业集团股份有限公司 | 2899 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 200,000 | 442,732.20 | 0.50 |
| 88 | BHP Billiton PLC | 必和必拓公司 | BLT LN | 伦敦证券交易所 | 英国 | 5,246 | 440,174.50 | 0.49 |
| 89 | TravelSky Technology Limited | 中国民航信息网络股份有限公司 | 696 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 34,000 | 432,988.67 | 0.49 |
| 90 | Huaneng Power International,Inc. | 华能国际电力股份有限公司 | 902 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 100,000 | 408,544.39 | 0.46 |
| 91 | China Everbright Limited | 中国光大控股有限公司 | 165 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 30,000 | 382,048.83 | 0.43 |
| 92 | Avichina Industry And Technology Company Limited | 中国航空科技工业股份有限公司 | 2357 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 80,000 | 367,177.13 | 0.41 |
| 93 | China Mengniu Dairy Company Limited | 中国蒙牛乳业有限公司 | 2319 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 30,000 | 345,638.81 | 0.39 |
| 94 | Livzon Pharmaceutical Group Inc | 丽珠集团 | 1513 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 10,000 | 297,861.34 | 0.33 |
| 95 | Beijing Tong Ren Tang Group Co., Ltd | 同仁堂国药 | 8138 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 33,000 | 259,203.46 | 0.29 |
| 96 | Beijing Enterprises Water Group Limited | 北控水务集团有限公司 | 371 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 10,000 | 39,828.80 | 0.04 |
| 97 | Sinosoft Technology Group Ltd | 中国擎天软件科技集团 | 1297 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 10,000 | 37,350.19 | 0.04 |
| 98 | Xinyi Automobile Glass Hong Kong | 信义汽车玻璃香港企业有限公司 | 8328 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 12,500 | 6,677.31 | 0.01 |

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

## 7.5报告期内权益投资组合的重大变动

**7.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2％或前20名的权益投资明细**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金  资产净值比例（％） |
| 1 | Union Pacific Corp | UNP US | 1,244,299.12 | 1.35 |
| 2 | Occidental Petroleum Corp | OXY US | 1,236,804.52 | 1.34 |
| 3 | Dow Chemical Company | DOW US | 1,111,245.52 | 1.20 |
| 4 | Hewlett Packard Enterprise | HPE US | 1,049,118.28 | 1.14 |
| 5 | Shire PLC | SHP LN | 951,518.98 | 1.03 |
| 6 | China State Construction International Holdings Limited | 3311 HK | 945,472.25 | 1.03 |
| 7 | Ingersoll-Rand PLC | IR US | 944,108.80 | 1.02 |
| 8 | Eaton Corp PLC | ETN US | 941,731.48 | 1.02 |
| 9 | Agricultural Bank of China Ltd | 1288 HK | 850,565.11 | 0.92 |
| 10 | China Hongqiao Group Ltd | 1378 HK | 837,098.74 | 0.91 |
| 11 | China Resources Land Limited | 1109 HK | 808,733.00 | 0.88 |
| 12 | BYD Company Limited | 1211 HK | 769,706.59 | 0.83 |
| 13 | Assa Abloy AB | ASSAB SS | 766,446.15 | 0.83 |
| 14 | Shanghai Jin Jiang International Hotels (Group) Company | 2006 HK | 734,120.72 | 0.80 |
| 15 | Huadian Power International Corporation Limited | 1071 HK | 732,369.11 | 0.79 |
| 16 | CRCC High-Tech Equipment Corporation Limited | 1786 HK | 717,123.09 | 0.78 |
| 17 | Facebook Inc | FB US | 668,347.12 | 0.72 |
| 18 | Cogobuy Group | 400 HK | 653,105.01 | 0.71 |
| 19 | HeidelbergCement AG | HEI GR | 648,604.07 | 0.70 |
| 20 | Huaneng Power International,Inc. | 902 HK | 647,582.84 | 0.70 |

注：1、“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用；

2、此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

**7.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2％或前20名的权益投资明细**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金  资产净值比例（％） |
| 1 | Sunac China Holdings Limited | 1918 HK | 2,486,029.17 | 2.70 |
| 2 | Diageo Plc | DGE LN | 1,316,438.71 | 1.43 |
| 3 | Tcl Multimedia Technology Holdings Limited | 1070 HK | 1,296,328.76 | 1.41 |
| 4 | Arm Holdings Plc | ARM LN | 1,212,826.04 | 1.31 |
| 5 | Haitong Securities Company Limited | 6837 HK | 1,019,606.42 | 1.11 |
| 6 | Intime Retail (Group) Company Limited | 1833 HK | 913,745.43 | 0.99 |
| 7 | Hong Kong Exchanges And Clearing Ltd | 388 HK | 913,121.73 | 0.99 |
| 8 | Schneider Electric Sa | SU FP | 903,162.64 | 0.98 |
| 9 | Shanghai Electric Group Company Limited | 2727 HK | 901,632.11 | 0.98 |
| 10 | Safran Sa | SAF FP | 863,776.11 | 0.94 |
| 11 | Sinosoft Technology Group Ltd | 1297 HK | 850,434.01 | 0.92 |
| 12 | Bbmg Corporation | 2009 HK | 819,490.20 | 0.89 |
| 13 | China Minsheng Banking Corp.,Ltd. | 1988 HK | 774,090.39 | 0.84 |
| 14 | Agricultural Bank Of China Ltd | 1288 HK | 741,127.75 | 0.80 |
| 15 | Nokia Corporation | NOKIA FH | 726,959.66 | 0.79 |
| 16 | Sinotruk (Hong Kong) Ltd. | 3808 HK | 726,578.71 | 0.79 |
| 17 | Xinyi Glass Holdings Ltd | 868 HK | 689,477.23 | 0.75 |
| 18 | Kingsoft Corporation Ltd. | 3888 HK | 671,192.14 | 0.73 |
| 19 | Essilor International Sa | EI FP | 648,097.01 | 0.70 |
| 20 | Akzo Nobel | AKZA NA | 647,222.00 | 0.70 |

注：1、“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；

2、此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

**7.5.3权益投资的买入成本总额及卖出收入总额**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 买入成本（成交）总额 | 32,939,274.99 |
| 卖出收入（成交）总额 | 33,077,552.83 |

注：“买入成本”或“卖出收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.6期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11投资组合报告附注

**7.11.1**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。

**7.11.2**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。

**7.11.3期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 名称 | 金额 |
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 425,916.45 |
| 4 | 应收利息 | 300.71 |
| 5 | 应收申购款 | 288,062.17 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 714,279.33 |

**7.11.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.11.5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。

**7.11.6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**

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 |
| 3,763 | 15,814.92 | 25,305,622.04 | 42.52% | 34,205,920.57 | 57.48% |

## 8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 647.42 | 0.00% |

## 8.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

# **§9开放式基金份额变动**

单位：份

|  |  |
| --- | --- |
| 基金合同生效日（2008年8月22日）基金份额总额 | 508,425,627.85 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 57,715,799.32 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4,775,667.18 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,979,923.89 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 59,511,542.61 |

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

# **§10重大事件揭示**

## 10.1基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：本报告期内，经公司第四届董事会第九次会议审议通过，乔宏军先生不再担任公司副总经理职务。基金管理人就上述重大人事变动已按照相关规定向监管部门报告并履行了必要的信息披露程序。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

## 10.5报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

（1）管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

针对中国证监会在2015年“两加强两遏制”检查后就公司内部控制提出的改进意见及采取责令改正的行政监管措施，以及上海证监局于本报告期内对公司相关负责人的警示，公司认真落实整改要求，完成相关问题的整改并向监管部门上报专项报告。整改工作中，公司进一步加强制度建设和风控措施，提升公司内部控制和风险管理水平。除上述情况外,报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

（2）托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

**10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
| 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 |
| UOB Kay Hian(Hong Kong) Limited | - | 13,764,778.63 | 20.85% | 16,517.75 | 25.28% | - |
| CICC Hong Kong Securities Limited | - | 10,990,043.87 | 16.65% | 16,485.06 | 25.23% | - |
| Bocom International Securities Limited | - | 6,692,615.34 | 10.14% | 6,692.62 | 10.24% | - |
| China Merchants Securities(HK)Co.Ltd. | - | 6,379,110.81 | 9.66% | 6,379.13 | 9.76% | - |
| Instinet Europe Limited London | - | 5,476,783.47 | 8.30% | 978.39 | 1.50% | - |
| Investment Technology Group Ltd Dublin | - | 5,451,975.90 | 8.26% | 5,996.96 | 9.18% | - |
| Merrill Lynch International London | - | 4,721,256.21 | 7.15% | 2,495.97 | 3.82% | - |
| KCG Americas LLC New York | - | 2,826,165.64 | 4.28% | 3,739.05 | 5.72% | - |
| UBS Securities LLC Stamford | - | 2,254,472.76 | 3.41% | 2,083.45 | 3.19% | - |
| Societe Generale London Branch | - | 1,710,931.54 | 2.59% | 1,073.75 | 1.64% | - |
| ITG Inc. New York | - | 1,245,799.61 | 1.89% | 146.78 | 0.22% | - |
| Instinet Pacific Ltd Hong Kong | - | 1,069,780.57 | 1.62% | 320.71 | 0.49% | - |
| Investment Technology Group Ltd Dublin (DMA) | - | 719,955.84 | 1.09% | 143.96 | 0.22% | - |
| Credit Suisse Securities (Europe) Ltd | - | 648,097.01 | 0.98% | 388.81 | 0.60% | - |
| Merrill Lynch Pierce Fenner and Smith Inc. New York | - | 642,736.75 | 0.97% | 449.91 | 0.69% | - |
| BOCI Securities Limited | - | 529,519.25 | 0.80% | 794.27 | 1.22% | - |
| UBS Securities Asia Limited Hong Kong | - | 498,468.65 | 0.76% | 149.52 | 0.23% | - |
| UBS Limited London | - | 204,253.96 | 0.31% | 224.68 | 0.34% | - |
| Jefferies International Limited London | - | 190,082.01 | 0.29% | 285.15 | 0.44% | - |
| 虚拟券商 | - | - | - | - | - | - |
| Yuanta Securities(HONG KONG)Company Limited | - | - | - | - | - | - |
| Instinet Europe Limited London | - | - | - | - | - | - |
| Shenyin Wanguo Securities(H.K.)Ltd | - | - | - | - | - | - |
| Guosen Securities(HK) Brokerage Company, Limited | - | - | - | - | - | - |
| Instinet Pacific Limited | - | - | - | - | - | - |
| Investment Technology Group Ltd Dublin | - | - | - | - | - | - |
| ITG Inc. New York | - | - | - | - | - | - |
| Merrill Lynch International London | - | - | - | - | - | - |
| Credit Suisse(Hong Kong) Ltd | - | - | - | - | - | - |
| Liquidnet Europe Limited London (International trades) | - | - | - | - | - | - |
| Societe Generale London Branch | - | - | - | - | - | - |
| Instinet Pacific Ltd Hong Kong | - | - | - | - | - | - |
| Credit Suisse (Hong Kong) Ltd Hong Kong | - | - | - | - | - | - |
| Merrill Lynch Pierce Fenner and Smith Inc. New York | - | - | - | - | - | - |
| Jefferies and Company Inc New York | - | - | - | - | - | - |
| BTIG LLC | - | - | - | - | - | - |
| UBS Securities Asia Limited Hong Kong | - | - | - | - | - | - |
| Imperial Capital LLC | - | - | - | - | - | - |
| Citigroup Global Markets Limited London | - | - | - | - | - | - |
| JP Morgan Securities LLC New York | - | - | - | - | - | - |
| UBS Limited London | - | - | - | - | - | - |
| Deutsche Bank AG | - | - | - | - | - | - |
| Deutsche Bank AG London Branch | - | - | - | - | - | - |
| Instinet LLC New York (DMA) | - | - | - | - | - | - |
| Barclays Capital Securities Limited London | - | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs International London | - | - | - | - | - | - |
| Citigroup Global Markets Ltd | - | - | - | - | - | - |
| J.P. Morgan Securities plc London | - | - | - | - | - | - |
| Deutsche Bank Securities Inc New York | - | - | - | - | - | - |
| Morgan Stanley & Co. International Plc London | - | - | - | - | - | - |
| UBS Securities LLC Stamford | - | - | - | - | - | - |
| Royal Bank of Canada London Branch | - | - | - | - | - | - |
| Morgan Stanley & Co Inc New York | - | - | - | - | - | - |
| State Street Global Markets LLC (DMA) | - | - | - | - | - | - |
| Jefferies LLC DMA | - | - | - | - | - | - |
| Barclays Capital Inc New York | - | - | - | - | - | - |
| Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited | - | - | - | - | - | - |
| KCG Americas LLC New York | - | - | - | - | - | - |
| J.P. Morgan Securities LLC | - | - | - | - | - | - |
| Banco Di Investimentos CSFB Garantia SA | - | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs Execution and Clearing DMA | - | - | - | - | - | - |
| CCB International Securities Limited | - | - | - | - | - | - |
| Nomura International Plc London (Offshore) | - | - | - | - | - | - |
| Macquarie Bank Limited | - | - | - | - | - | - |
| CLSA Ltd | - | - | - | - | - | - |
| RBC Capital Markets Inc Toronto DMA | - | - | - | - | - | - |
| Macquarie Equities Ltd London | - | - | - | - | - | - |
| Barclays Bank Plc London | - | - | - | - | - | - |
| Sanford C. Bernstein & Co. LLC NY | - | - | - | - | - | - |
| J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited HK | - | - | - | - | - | - |
| Citigroup Global Markets Inc. NY (DTC418) | - | - | - | - | - | - |
| HSBC Bank Plc London (equities) | - | - | - | - | - | - |
| Jefferies International Limited London | - | - | - | - | - | - |
| Oriental Patron Securities Limited | - | - | - | - | - | - |
| UBS Securities Hong Kong Ltd | - | - | - | - | - | - |
| DBS Vickers Securities (Singapore) Pte Ltd Singapore | - | - | - | - | - | - |
| UBS Securities Ltd London | - | - | - | - | - | - |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC New York | - | - | - | - | - | - |
| Mizuho Securities Asia Limited Hong Kong | - | - | - | - | - | - |
| BNP Paribas Peregrine HK | - | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs & Co New York | - | - | - | - | - | - |
| Exane Ltd London | - | - | - | - | - | - |
| Deutsche Securities Asia Ltd Singapore | - | - | - | - | - | - |
| Cowen & Company LLC New York (DMA) | - | - | - | - | - | - |
| Itau BBA USA Securities Inc | - | - | - | - | - | - |
| Redburn (Europe) Limited London | - | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs (ASIA) Securities Limited | - | - | - | - | - | - |
| Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith New York | - | - | - | - | - | - |
| Citigroup Global Markets New York | - | - | - | - | - | - |
| Morgan Stanley Hong Kong | - | - | - | - | - | - |
| Redburn Partners LLP | - | - | - | - | - | - |
| J.P. Morgan Securities LLC NY (DMA) | - | - | - | - | - | - |
| RBC Capital Markets Corporation New York | - | - | - | - | - | - |
| Cormark Securities Inc | - | - | - | - | - | - |
| China Securities(International)Brokerage Company Limited | - | - | - | - | - | - |
| Mitsubishi UFJ Securities International Plc London | - | - | - | - | - | - |
| Leerink Swann & Co | - | - | - | - | - | - |
| Macquarie Securities (USA) Inc | - | - | - | - | - | - |
| ITG Australia Limited Sydney | - | - | - | - | - | - |
| HSBC Securities Inc | - | - | - | - | - | - |
| Macquarie Equities Ltd Sydney | - | - | - | - | - | - |
| DB UK Bank Ltd London | - | - | - | - | - | - |
| Kempen & Co NV Amsterdam | - | - | - | - | - | - |
| UBS Securities Singapore Ltd | - | - | - | - | - | - |
| Deutsche Securities Australia Ltd Sydney | - | - | - | - | - | - |
| Merrill Lynch Equities (Australia) Ltd Sydney | - | - | - | - | - | - |
| CIMB Securities (Australia) Limited Sydney | - | - | - | - | - | - |
| Credit Suisse (Seoul) Ltd Seoul | - | - | - | - | - | - |
| JP Morgan Securities (Asia Pacific) Ltd.Hong Kong | - | - | - | - | - | - |
| JP Morgan Securities Australia Ltd Sydney | - | - | - | - | - | - |
| UBS Securities Australia Equities Ltd Sydney | - | - | - | - | - | - |
| ABN Amro Australia Limited | - | - | - | - | - | - |
| ABN Amro Bank N.V. | - | - | - | - | - | - |
| ABS Sundal Collier | - | - | - | - | - | - |
| Albert Fried & Company LLC | - | - | - | - | - | - |
| Anglo Irish Bank | - | - | - | - | - | - |
| Barclays Capital Group | - | - | - | - | - | - |
| Barclays Capital Inc. | - | - | - | - | - | - |
| Barclays Capital Securities Thailand | - | - | - | - | - | - |
| BNP Paribas Securities(Asia)Ltd. | - | - | - | - | - | - |
| BNP Paribas UK Ltd London | - | - | - | - | - | - |
| BRADESCO SEC | - | - | - | - | - | - |
| BSCH New York | - | - | - | - | - | - |
| Calyon Securities (New York) | - | - | - | - | - | - |
| CITIC Securities Brokerage (HK) Limited | - | - | - | - | - | - |
| Citigroup Global Markets Australia Pty | - | - | - | - | - | - |
| Citigroup Global Markets UK Equity | - | - | - | - | - | - |
| CSFB Singapore Securities PTE Limited | - | - | - | - | - | - |
| Daiwa Securities (HK) Ltd Hong Kong | - | - | - | - | - | - |
| DBS Vickers Securities (Singapore) Pte | - | - | - | - | - | - |
| Deutsche Bank Alex Brown Inc | - | - | - | - | - | - |
| Deutsche Securities Asia Ltd | - | - | - | - | - | - |
| Evolution Group Plc | - | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs Australia Pty Ltd Melbourne | - | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs International Limited | - | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs JB Were Pty Ltd Melbourne | - | - | - | - | - | - |
| Guoyuan Securities Brokerage(Hong Kong) Ltd | - | - | - | - | - | - |
| Haitong International Securities Company Limited | - | - | - | - | - | - |
| ICAP CORP LLC | - | - | - | - | - | - |
| Instinet Corporation | - | - | - | - | - | - |
| Instinet Corporation New York (DMA) | - | - | - | - | - | - |
| Investec Securities London | - | - | - | - | - | - |
| ITG Australia Ltd Melbourne | - | - | - | - | - | - |
| ITG EUROPE LTD | - | - | - | - | - | - |
| ITG Ltd - Hong Kong | - | - | - | - | - | - |
| ITG Triton | - | - | - | - | - | - |
| ITG Triton (US) | - | - | - | - | - | - |
| J P Morgan Securities Inc N.Y. | - | - | - | - | - | - |
| J P Morgan Securities Ltd | - | - | - | - | - | - |
| J P Morgan Securities Ltd London | - | - | - | - | - | - |
| J. & E.Davy | - | - | - | - | - | - |
| Jefferies & Co Inc | - | - | - | - | - | - |
| Jefferies International Limited | - | - | - | - | - | - |
| JP Morgan Chase Bank - London (TRS) | - | - | - | - | - | - |
| JP Morgan Securities (Asia Pacific) Korea | - | - | - | - | - | - |
| JP Morgan Securities. (Asia Pacific) Ltd | - | - | - | - | - | - |
| Lehman Brothers International (Europe) | - | - | - | - | - | - |
| LIQUIDNET | - | - | - | - | - | - |
| Liquidnet (International Trades) | - | - | - | - | - | - |
| Liquidnet Australia Pty Ltd | - | - | - | - | - | - |
| LIQUIDNET EURO | - | - | - | - | - | - |
| Liquidnet Inc New York (US$ Trades) | - | - | - | - | - | - |
| Macquarie Equities New Zealand Ltd | - | - | - | - | - | - |
| Macquarie Securities(Singapore)Pte Ltd | - | - | - | - | - | - |
| Macquarie Securities HK | - | - | - | - | - | - |
| Merrill Lynch Far East Limited | - | - | - | - | - | - |
| Merrill Lynch Fund Managers | - | - | - | - | - | - |
| Merrill Lynch London | - | - | - | - | - | - |
| Merrill Lynch Singapore DMA | - | - | - | - | - | - |
| Mitsubishi Securities International | - | - | - | - | - | - |
| Mizuho Securities Asia Ltd (HongKong) | - | - | - | - | - | - |
| Mizuho Securities Co (Tokyo) | - | - | - | - | - | - |
| Morgan Grenfell & Co | - | - | - | - | - | - |
| Morgan Stanley | - | - | - | - | - | - |
| Morgan Stanley International Ltd | - | - | - | - | - | - |
| Morgan Stanley N Co Intl Ltd ( Seoul ) | - | - | - | - | - | - |
| Nomura International Ltd London | - | - | - | - | - | - |
| Nomura International PLC. | - | - | - | - | - | - |
| Panmure Gordon Limited | - | - | - | - | - | - |
| PIPER JAFFRAY ASIA SECURITIES LIMITED | - | - | - | - | - | - |
| RBC Capital Markets Corp | - | - | - | - | - | - |
| RBC Dain Rauscher Inc Minneapolis | - | - | - | - | - | - |
| Redburn Partners | - | - | - | - | - | - |
| Redburn Partners LLP (DMA) London | - | - | - | - | - | - |
| Royal Bank of Scotland Plc London | - | - | - | - | - | - |
| S J LEVINSON | - | - | - | - | - | - |
| Samsung Securities Asia Limited | - | - | - | - | - | - |
| Scotia Capital (USA) Inc | - | - | - | - | - | - |
| SG Securities (London) Ltd | - | - | - | - | - | - |
| Southern Cross Equities Limited | - | - | - | - | - | - |
| UBS Securities Ltd | - | - | - | - | - | - |
| UBS Singapore DMA | - | - | - | - | - | - |
| WALL ST ACCESS | - | - | - | - | - | - |
| Wall Street Access Corporation | - | - | - | - | - | - |

**10.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
| 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 虚拟券商 | - | - | - | - | 15,417.31 | 100.00% | - | - |

注：1、本公司从事境外投资业务时，将需要委托境外券商代理或协助进行交易操作。本公司作为基金管理人将勤勉尽责地承担受信责任，挑选、委托合适的境外券商以取得有益于基金持有人利益的最佳执行；

2、本公司投资海外市场，遵循公平分配、最佳执行的原则。本公司挑选券商并开户均主要遵循以下原则：券商基本面评价，包括财务状况和经营状况； 券商研究及服务质量，包括其研究报告质量、数量和及时性，包括券商在股票配售等公司行为发生时所提供的服务；券商的交易执行能力，即是否对投资指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量券商交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场价格及流动性的影响等。能够及时准确高效地提供结算等后台业务支持。

## 10.8其他重大事件

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
| 1 | 交银施罗德基金管理有限公司关于旗下基金在指数熔断期间调整开放时间的补充公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-01-06 |
| 2 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金分红的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-01-11 |
| 3 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-01-14 |
| 4 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加大泰金石投资管理有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与电子交易平台基金前端申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-01-15 |
| 5 | 交银施罗德环球精选价值证券投资基金2015年第4季度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-01-21 |
| 6 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-02-05 |
| 7 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与网上电子交易平台基金前端申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-03-01 |
| 8 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-03-22 |
| 9 | 交银施罗德环球精选价值证券投资基金2015年年度报告摘要 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-03-29 |
| 10 | 交银施罗德环球精选价值证券投资基金（更新）招募说明书摘要（2016年第1号） | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-04-07 |
| 11 | 交银施罗德环球精选价值证券投资基金2016年第1季度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-04-20 |
| 12 | 交银施罗德基金管理有限公司关于网上直销交易平台关闭支付宝基金网上支付服务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-05-10 |
| 13 | 交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国民生银行股份有限公司直销银行“基金通”平台销售系统基金前端申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-05-16 |
| 14 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-05-26 |
| 15 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与电子交易平台基金前端申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-06-08 |
| 16 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-06-29 |
| 17 | 交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司基金网上银行、手机银行前端申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-06-29 |
| 18 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与电子交易平台基金前端申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-06-29 |

# **§11备查文件目录**

## 11.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德环球精选价值证券投资基金募集的文件；

2、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金托管协议》；

5、关于申请募集交银施罗德环球精选价值证券投资基金之法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照；

8、报告期内交银施罗德环球精选价值证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

## 11.2存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

## 11.3查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com，www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。